



**ALLIANCEBERNSTEIN®**

HALBJAHRESBERICHT

# AB FCP I

Bestimmte Portefeuilles des Fonds sind nicht zum Angebot an nicht qualifizierte Anleger in der Schweiz zugelassen. Dementsprechend wurden alle Bezugnahmen auf diese Portefeuilles aus diesem verkürzten Halbjahresbericht entfernt. Die Anleger werden auf die Tatsache hingewiesen, dass bestimmte Zahlen in diesem verkürzten Halbjahresbericht auf konsolidierter Basis dargestellt sind und daher die Zahlen der Portefeuilles umfassen, die für das Angebot an nicht qualifizierte Anleger in der Schweiz nicht registriert sind.

## **Multi-Asset/Asset Allocation**

+ DYNAMIC DIVERSIFIED PORTFOLIO

## **Equity**

+ GLOBAL EQUITY BLEND PORTFOLIO

+ GLOBAL VALUE PORTFOLIO

+ EMERGING MARKETS GROWTH PORTFOLIO

+ SUSTAINABLE US THEMATIC PORTFOLIO

+ ASIA EX-JAPAN EQUITY PORTFOLIO

+ JAPAN STRATEGIC VALUE PORTFOLIO

+ CHINA LOW VOLATILITY EQUITY PORTFOLIO

## **Fixed Income**

+ SHORT DURATION BOND PORTFOLIO

+ GLOBAL HIGH YIELD PORTFOLIO

+ AMERICAN INCOME PORTFOLIO

+ EUROPEAN INCOME PORTFOLIO

+ EMERGING MARKETS DEBT PORTFOLIO

+ MORTGAGE INCOME PORTFOLIO

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

RCS: K217

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

---

	<b>Seite</b>
Brief an die Anteilhaber .....	1
Wertentwicklung der Anteile .....	2
Verzeichnis der Anlagewerte .....	14
Zusammensetzung des Fondsvermögens .....	144
Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens .....	148
Umlaufende Anteile .....	152
Statistische Informationen .....	160
Anmerkungen zum Halbjahresabschluss .....	176
Tabelle 1 – Gebührenstruktur .....	198
Tabelle 2 – Portefeuilleumsatz .....	212
Informationen für die Anteilhaber (ungeprüft) .....	213

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

21. März 2021

Sehr geehrte Anteilinhaber,

der vorliegende Bericht bietet Ihnen eine aktuelle Übersicht über AB FCP I (der „Fonds“) für den Halbjahresberichtszeitraum zum 28. Februar 2022.

In dem Sechsmonatszeitraum zum 28. Februar 2022 haben US-Aktien, internationale Aktien und Emerging Market Equities an Boden verloren. Die expansive Geldpolitik unterstützte weiterhin eine sich beschleunigende Konjunkturerholung, doch trotz der allgemein guten Unternehmensgewinne und Wirtschaftsdaten erlebten die Aktienmärkte im Laufe des Zeitraums einen dramatischen Anstieg der Volatilität. Die anhaltend hohe Inflation und die Straffung der Geldpolitik, insbesondere in den USA, dämpften die Anlegerstimmung. Verschärft wurde die Situation durch die russische Invasion in der Ukraine Ende Februar, die sowohl die Verhängung schwerer Wirtschaftssanktionen gegen Russland als auch eine allgemeine Flucht in „sichere“ Anlagen, einschließlich des US-Dollars und US-Staatsanleihen, auslöste.

Die Aktienmärkte machten Ende des Monats etwas Boden gut, da spekuliert wurde, dass der Krieg zwischen Russland und der Ukraine die US-Notenbank veranlassen könnte, die Normalisierung der Geldpolitik zu verlangsamen. Jedoch wurden die Aktienkurse durch die Angst vor einem Abwürgen des Wirtschaftswachstums belastet. Vor dem Hintergrund steigender Zinsen schnitten wertorientierte Aktien besser ab als wachstumsorientierte Aktien, die am Ende im negativem Bereich lagen. Sowohl Large- als auch Small-Cap-Aktien gingen zurück, jedoch schnitten Large-Cap-Aktien deutlich besser ab als Small Caps.

Die Renditen an den Rentenmärkten stiegen aufgrund der Inflationsängste, was zu einem Rückgang der Anleihenurse in allen Regionen führte. Die Zentralbanken hielten sich mit Zinserhöhungen zurück, was dazu führte, dass die kurzfristigen Renditen an vielen Märkten schneller stiegen als die längeren Laufzeiten. Die globalen inflationsgebundenen Anleihen führten die relativen Erträge an, da sie im Vergleich zu den US-Schatzanleihen den geringsten Rückgang verzeichneten. Die Nachfrage der Anleger nach ertragsstärkeren Anlagen führte dazu, dass hochverzinsliche Industrieschuldverschreibungen in den Industrieländern im risikoscheuen Umfeld eine ähnliche Performance aufwiesen wie globale Schatzanleihen, während hochverzinsliche Industrieschuldverschreibungen in den USA gegenüber US-Schatzanleihen eine Outperformance aufwiesen.

Industrieschuldverschreibungen mit Anlagequalität, die in der Regel längere Laufzeiten haben und anfälliger für Veränderungen der Renditen sind als hochverzinsliche Industrieschuldverschreibungen, schnitten insbesondere in den USA schlechter ab als Staatsanleihen. Staatsanleihen, Industrieschuldverschreibungen und auf Lokalwährungen lautende Anleihen aus Schwellenländern gaben nach, als der US-Dollar gegenüber allen wichtigen Währungen der Industrieländer und den meisten Schwellenmarktwährungen zulegte. Die Preise für Rohöl der Sorte Brent stiegen kräftig, während Kupfer und Gold bescheidene Gewinne erzielten.

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>
<b><u>Dynamic Diversified Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	-6.93%	2.50%	18.95%	50.33%
A EUR.....	-2.00%	10.31%(a)	20.21%	93.37%
A EUR H.....	-7.31%	1.60%	17.57%	31.07%
AX.....	-6.92%	2.57%	19.03%	81.27%
AX EUR.....	-1.94%	10.43%(a)	20.22%	105.51%
AX SGD.....	-6.13%	4.39%(a)	17.59%	42.93%
BX.....	-7.33%	1.60%	17.78%	52.67%
BX SGD.....	-6.58%	3.46%(a)	16.45%	20.98%
C.....	-7.07%	2.19%	18.58%	46.27%
C EUR.....	-2.15%	10.00%(a)	19.83%	88.17%
C EUR H.....	-7.45%	1.27%	17.17%	27.60%
CX.....	-7.02%	2.29%	18.61%	73.00%
I.....	-6.61%	3.25%	19.78%	61.00%
I EUR.....	-1.64%	11.15%(a)	21.00%	107.12%
I EUR H.....	-6.98%	2.28%	18.36%	40.33%
IX.....	-6.57%	3.33%	19.83%	102.87%
S1 EUR H.....	-6.77%	2.77%	18.90%	48.60%
<b><u>Global Equity Blend Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	-8.62%	5.19%	34.67%	169.40%
A EUR.....	-3.80%	13.19%(a)	36.08%	182.92%
A EUR H.....	-9.06%	4.15%	33.00%	60.53%
A SGD.....	-7.86%	7.06%(a)	33.08%	75.64%
B.....	-9.09%	4.14%	33.35%	123.90%
B SGD.....	-8.33%	6.00%(a)	31.77%	48.85%
C.....	-8.84%	4.72%	34.11%	108.92%
C EUR.....	-5.47%(1)	-	35.59%	-5.47%
I.....	-8.29%	6.02%	35.78%	213.20%
I EUR.....	-3.42%	14.14%(a)	37.19%	228.98%
S HKD.....	-7.33%	7.99%(a)	37.70%	188.98%
S1.....	-8.09%	6.43%	36.26%	201.41%
S1 EUR.....	-3.22%	14.54%(a)	37.70%	234.43%
S1 GBP.....	-5.78%	10.62%(a)	32.45%	270.01%
S1 SGD.....	-7.33%	8.34%(a)	34.64%	110.61%
<b><u>Global Value Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	-5.25%	7.99%	33.86%	109.40%
A EUR.....	-0.27%	16.25%(a)	35.26%	66.85%
A SGD.....	-4.44%	9.94%(a)	32.30%	9.48%
A SGD H.....	-5.24%	7.90%	33.39%	41.07%
AD.....	-5.27%	7.96%	33.96%	45.05%
AD AUD H.....	-5.44%	7.56%	32.30%	40.36%
AD CAD H.....	-5.34%	7.59%	32.80%	36.01%
AD EUR H.....	-5.73%	6.86%	32.18%	28.62%
AD GBP H.....	-5.33%	7.51%	32.52%	31.82%
AD HKD.....	-4.81%	8.77%(a)	34.43%	46.98%
AD SGD H.....	-5.28%	7.92%	33.52%	40.96%
AD ZAR H.....	-2.81%	13.16%	39.20%	103.79%
B.....	-5.70%	6.97%	32.58%	70.40%
C.....	-5.45%	7.47%	32.60%	98.25%
C EUR.....	-0.46%	15.69%(a)	33.29%	106.24%
I.....	-4.88%	8.86%	34.63%	145.60%
I EUR.....	0.18%	17.18%(a)	34.97%	87.82%
I GBP.....	-2.33%(2)	-	36.37%	-2.33%
I SGD.....	-4.09%	10.81%(a)	33.36%	23.59%
S.....	-4.47%	9.82%	36.20%	91.51%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Global Value Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
S GBP .....	-2.09%	14.22%(a)	32.47%	160.97%
S GBP H .....	-4.52%	9.39%	34.87%	50.67%
S1 .....	-4.82%	9.02%	35.26%	108.64%
S1 EUR .....	0.26%	17.41%(a)	36.66%	149.57%
S1 GBP .....	-2.43%	13.35%(a)	31.47%	205.06%
SD .....	-4.48%	9.82%	36.22%	68.70%

**Emerging Markets Growth Portfolio**

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Klasse</b>				
A .....	-13.70%	-18.39%	16.77%	382.00%
A AUD H .....	-14.10%	-19.08%	15.32%	40.53%
A EUR .....	-9.11%	-12.16%(a)	17.96%	161.43%
A HKD .....	-13.28%	-17.76%(a)	17.19%	43.56%
A PLN H .....	-13.62%	-18.80%	15.02%	7.67%
A SGD .....	-12.96%	-16.91%(a)	15.39%	53.62%
A SGD H .....	-13.79%	-18.57%	16.28%	9.60%
AD .....	-13.70%	-18.39%	16.73%	34.38%
B .....	-14.12%	-19.18%	15.61%	261.90%
C .....	-13.89%	-18.75%	16.25%	153.10%
C AUD H .....	-14.29%	-19.48%	14.75%	32.00%
C EUR .....	-9.33%	-12.54%(a)	17.48%	131.35%
ED .....	-14.09%	-19.16%	15.60%	-4.81%
I .....	-13.35%	-17.72%	17.71%	230.91%
I AUD H .....	-13.76%	-18.43%	16.26%	52.53%
I EUR .....	-8.76%	-11.44%(a)	18.94%	210.10%
N .....	-13.89%	-18.74%	16.28%	57.87%
S .....	-12.89%	-16.83%	18.98%	117.57%
S1 .....	-13.27%	-17.57%	17.92%	199.66%
S1 EUR .....	-8.65%	-11.25%(a)	19.14%	245.92%
S1 GBP .....	-11.10%	-14.30%(a)	14.67%	313.10%

**Asia Ex-Japan Equity Portfolio**

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Klasse</b>				
A .....	-5.03%	-3.46%	32.23%	74.80%
A AUD H .....	-5.34%	-4.24%	30.35%	74.80%
A EUR .....	0.00%	3.91%(a)	33.60%	134.03%
A HKD .....	-4.57%	-2.72%(a)	32.70%	76.28%
A SGD H .....	-5.09%	-3.73%	31.52%	25.67%
AD .....	-5.04%	-3.43%	32.29%	74.90%
AD AUD H .....	-5.36%	-4.26%	30.38%	75.14%
AD CAD H .....	-5.31%	-4.08%	31.11%	24.81%
AD EUR .....	0.05%	3.95%(a)	33.66%	134.23%
AD EUR H .....	-5.50%	-4.57%	30.32%	27.21%
AD GBP H .....	-5.29%	-4.06%	30.89%	40.78%
AD HKD .....	-4.57%	-2.70%(a)	32.75%	76.37%
AD NZD H .....	-5.04%	-3.97%	30.89%	65.19%
AD RMB H .....	-3.74%	-0.87%	34.60%	72.21%
AD SGD H .....	-5.06%	-3.67%	31.58%	35.41%
AD ZAR H .....	-2.99%	0.45%	36.93%	132.91%
AY JPY .....	-0.75%	4.12%	37.36%	117.19%
BD .....	-5.49%	-4.41%	30.90%	54.67%
BD AUD H .....	-5.86%	-5.24%	29.07%	56.62%
BD CAD H .....	-5.75%	-4.94%	29.89%	16.77%
BD HKD .....	-5.04%	-3.65%(a)	31.40%	56.02%
BD NZD H .....	-5.51%	-4.91%	29.65%	50.28%
BY JPY .....	-0.99%	3.64%	36.73%	106.95%
C .....	-5.23%	-3.87%	31.61%	65.47%
C AUD H .....	-5.55%	-4.66%	29.84%	69.07%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Asia Ex-Japan Equity Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
C EUR.....	-0.14%	3.51%(a)	32.91%	121.62%
ED.....	-5.45%	-4.37%	30.91%	4.79%
I.....	-4.65%	-2.69%	33.30%	92.87%
I AUD H.....	-4.95%	-3.45%	31.40%	95.67%
I EUR.....	0.39%	4.75%(a)	34.70%	158.26%
I GBP.....	-2.30%	1.04%	29.65%	61.47%
ID.....	-4.66%	-2.71%	33.28%	93.00%
ID AUD H.....	-4.99%	-3.51%	31.36%	95.47%
S.....	-4.15%	-1.64%	34.74%	120.33%
S HKD.....	-3.69%	-0.88%(a)	35.24%	93.21%
S1.....	-4.59%	-2.54%	33.56%	96.93%
S1 EUR.....	0.50%	4.94%(a)	34.95%	163.76%
SD.....	-4.14%	-1.64%	34.75%	78.96%

**Japan Strategic Value Portfolio**

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Klasse</b>				
A.....	-0.91%	4.22%	22.36%	15.70%
A AUD H.....	-1.19%	3.50%	21.31%	49.60%
A CZK H.....	0.08%	5.03%	21.36%	-4.69%
A EUR.....	-0.18%	4.03%(a)	19.12%	24.98%
A EUR H.....	-1.44%	3.16%	21.13%	78.20%
A NZD H.....	-0.93%	4.06%	21.87%	64.13%
A PLN.....	3.92%	2.53%(a)(b)	-	2.53%
A SGD.....	-4.39%	-1.71%(a)	16.31%	-0.87%
A SGD H.....	-0.96%	4.09%	22.31%	10.40%
A USD.....	-5.18%	-3.38%(a)	17.90%	17.19%
A USD H.....	-0.91%	4.19%	22.52%	118.53%
AD.....	-0.91%	4.19%	22.32%	43.47%
AD AUD H.....	-1.17%	3.55%	21.29%	45.58%
AD NZD H.....	-0.92%	4.05%	21.85%	54.46%
AD USD H.....	-0.88%	4.20%	22.50%	38.17%
AD ZAR H.....	1.39%	8.65%	27.68%	115.41%
C.....	-1.20%	3.58%	21.69%	8.23%
C EUR.....	-0.44%	3.49%(a)	18.52%	25.28%
C EUR H.....	-1.69%	2.66%	20.61%	67.20%
C USD.....	-5.46%	-3.92%(a)	17.29%	9.76%
I.....	-0.49%	5.00%	23.26%	31.79%
I EUR.....	0.26%	4.87%(a)	20.03%	52.51%
I EUR H.....	-1.04%	4.00%	22.12%	95.60%
I SGD.....	-4.00%	-0.97%(a)	17.21%	12.05%
I USD.....	-4.79%	-2.64%(a)	18.80%	33.62%
I USD H.....	-0.50%	5.02%	23.47%	137.27%
S EUR H.....	-0.48%	5.22%	23.60%	94.93%
S1 EUR.....	0.45%	5.35%(a)	20.65%	50.29%
S1 USD.....	-4.61%	-2.19%(a)	19.41%	40.87%
S1 USD H.....	-0.31%	5.54%	24.18%	71.33%
SD.....	0.00%	6.23%	24.80%	72.45%

**China Low Volatility Equity Portfolio**

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Klasse</b>				
A.....	-13.10%	-25.46%	-4.08%	459.70%
A EUR.....	-8.49%	-19.77%(a)	-3.09%	203.40%
A HKD.....	-12.69%	-24.90%(a)	-3.73%	40.53%
A PLN H.....	-13.13%	-25.94%	-5.05%	-6.73%
AD.....	-13.12%	-25.49%	-4.05%	47.25%
AD AUD H.....	-13.53%	-26.24%	-4.96%	39.36%
AD CAD H.....	-13.46%	-25.98%	-4.60%	35.68%
AD EUR H.....	-13.57%	-26.37%	-5.21%	27.64%



	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>China Low Volatility Equity Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
AD GBP H .....	-13.39%	-25.95%	-4.62%	33.26%
AD HKD .....	-12.70%	-24.92%(a)	-3.71%	49.77%
AD NZD H .....	-13.28%	-26.04%	-4.83%	45.71%
AD RMB H .....	-11.96%	-23.49%	-2.21%	66.55%
AD SGD H .....	-13.20%	-25.65%	-4.32%	38.44%
AD ZAR H .....	-11.63%	-22.87%	-0.41%	100.55%
B .....	-13.54%	-26.21%	-5.01%	338.70%
B EUR .....	-8.96%	-20.57%(a)	-4.02%	154.36%
BD NZD H .....	-13.76%	-26.79%	-5.71%	34.99%
C .....	-13.31%	-25.80%	-4.51%	27.99%
C EUR .....	-8.71%	-20.14%(a)	-3.51%	48.52%
I .....	-12.77%	-24.88%	-3.31%	577.50%
I EUR .....	-8.15%	-19.14%(a)	-2.30%	249.05%
S .....	-12.32%	-24.10%	-2.31%	192.80%
S1 .....	-12.64%	-24.67%	-3.05%	148.74%
S1 EUR .....	-8.02%	-18.91%(a)	-2.02%	208.42%

**Short Duration Bond Portfolio**

<b>Klasse</b>				
A .....	-1.82%	-1.57%	0.11%	115.62%
A EUR .....	3.41%	5.94%(a)	1.24%	21.35%
A2 .....	-1.79%	-1.58%	0.05%	73.73%
A2 EUR .....	3.39%	5.97%(a)	1.10%	20.96%
A2 EUR H .....	-2.14%	-2.34%	-0.82%	-5.53%
A2 HKD .....	-1.33%	-0.80%(a)	0.45%	32.16%
A2 SGD H .....	-1.80%	-1.54%	0.06%	2.07%
AA .....	-1.80%	-1.61%	0.05%	1.98%
AA AUD H .....	-1.86%	-1.86%	-0.34%	5.88%
AA CAD H .....	-1.79%	-1.67%	-0.10%	-0.13%
AA GBP H .....	-1.80%	-1.77%	-0.28%	-3.73%
AA HKD .....	-1.33%	-0.81%(a)	0.47%	2.80%
AA NZD H .....	-1.59%	-1.45%	-0.07%	8.92%
AA SGD H .....	-1.80%	-1.61%	-0.03%	0.50%
AJ .....	-1.71%	-1.37%	0.29%	92.40%
AR EUR H .....	-2.18%	-2.39%	-0.79%	-9.27%
AT .....	-1.82%	-1.57%	-0.02%	56.25%
AT AUD H .....	-1.88%	-1.88%	-0.34%	22.55%
AT CAD H .....	-1.84%	-1.66%	-0.06%	5.80%
AT EUR .....	3.42%	5.95%(a)	1.09%	58.61%
AT EUR H .....	-2.19%	-2.47%	-0.91%	-6.45%
AT GBP H .....	-1.82%	-1.72%	-0.21%	-0.70%
AT HKD .....	-1.33%	-0.78%(a)	0.37%	32.07%
AT NZD H .....	-1.62%	-1.43%	-0.02%	11.95%
AT SGD H .....	-1.75%	-1.55%	0.01%	-0.36%
AX .....	-1.62%	-1.32%	0.13%	182.32%
B .....	-2.30%	-2.55%	-0.90%	66.83%
C .....	-2.02%	-1.99%	-0.34%	54.49%
C2 .....	-2.04%	-1.97%	-0.33%	50.66%
C2 EUR H .....	-2.33%	-2.75%	-1.22%	-10.53%
I .....	-1.53%	-1.01%	0.55%	142.59%
I EUR .....	3.73%	6.56%(a)	1.66%	36.79%
I2 .....	-1.50%	-0.98%	0.60%	41.95%
I2 AUD H .....	-1.59%	-1.15%	0.35%	31.67%
I2 EUR .....	3.72%	6.55%(a)	1.62%	61.74%
I2 EUR H .....	-1.95%	-1.82%(a)	-0.19%	0.73%
IT .....	-1.52%	-1.03%	0.59%	6.02%
IT AUD H .....	-1.63%	-1.22%	0.35%	12.57%
N2 .....	-2.04%	-2.04%	-0.41%	-3.80%
NT .....	-2.01%	-2.09%	-0.49%	-3.91%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
S .....	-1.28%	-0.55%	1.08%	2.04%
S EUR H .....	-1.63%	-1.28%	0.24%	8.33%
S SGD H .....	-1.28%	-0.50%	1.12%	18.40%
S1 2 .....	-1.42%	-0.78%	0.84%	10.93%
S1 2 EUR .....	3.85%	6.84%(a)	1.85%	23.56%
S1 EUR H .....	-1.79%	-1.54%	0.00%	2.53%
SA .....	-1.28%	-0.50%	1.14%	12.81%
<b>Global High Yield Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	-5.34%	-1.91%	10.64%	241.99%
A EUR .....	0.04%	5.65%(a)	11.68%	176.08%
A2 .....	-5.21%	-1.66%	10.63%	274.04%
A2 CHF H .....	-5.65%	-2.73%	9.19%	4.60%
A2 EUR .....	-0.13%	5.87%(a)	11.78%	194.42%
A2 EUR H .....	-5.58%	-2.47%	9.52%	57.93%
A2 HKD .....	-4.77%	-0.90%(a)	11.06%	196.63%
A2 PLN H .....	-4.69%	-1.35%	9.94%	3.57%
A2 SGD .....	-4.38%	0.13%(a)	9.29%	62.97%
A2 SGD H .....	-5.19%	-1.64%	10.49%	43.80%
AA .....	-5.21%	-1.70%	10.53%	25.48%
AA AUD H .....	-5.33%	-1.92%	10.08%	25.31%
AA CAD H .....	-5.25%	-1.85%	10.29%	15.48%
AA EUR H .....	-5.60%	-2.51%	9.45%	6.27%
AA GBP H .....	-5.36%	-1.86%	10.18%	11.64%
AA HKD .....	-4.75%	-0.91%(a)	10.96%	22.61%
AA NZD H .....	-5.15%	-1.64%	10.29%	25.34%
AA RMB H .....	-4.00%	1.04%	13.03%	40.98%
AA SGD H .....	-5.11%	-1.60%	10.45%	20.34%
AA ZAR H .....	-2.85%	3.19%	15.46%	80.33%
AK .....	-5.15%	-1.65%	10.56%	30.02%
AK EUR .....	-0.25%	5.79%(a)	11.74%	50.83%
AK EUR H .....	-5.53%	-2.48%	9.46%	13.66%
AR EUR H .....	-5.59%	-2.40%	9.53%	7.96%
AT .....	-5.14%	-1.69%	10.42%	317.86%
AT AUD H .....	-5.33%	-1.97%	9.97%	92.95%
AT CAD H .....	-5.37%	-1.83%	10.35%	44.19%
AT EUR .....	0.02%	6.02%(a)	11.41%	145.88%
AT EUR H .....	-5.60%	-2.51%	9.44%	57.07%
AT GBP H .....	-5.33%	-1.90%	10.19%	46.69%
AT HKD .....	-4.76%	-0.94%(a)	10.90%	197.06%
AT NZD H .....	-5.02%	-1.56%	10.22%	45.38%
AT RMB H .....	-4.00%	1.03%	13.04%	77.96%
AT SGD .....	-4.40%	0.00%(a)	9.27%	97.88%
AT SGD H .....	-5.23%	-1.62%	10.57%	43.55%
B .....	-5.81%	-2.87%	9.56%	163.99%
B2 .....	-5.68%	-2.64%	9.55%	238.59%
BA .....	-5.69%	-2.60%	9.57%	15.78%
BA AUD H .....	-5.80%	-2.86%	9.05%	15.48%
BT .....	-5.71%	-2.50%	9.56%	162.19%
BT AUD H .....	-5.81%	-2.94%	8.97%	71.61%
BT CAD H .....	-5.75%	-2.71%	9.36%	28.24%
BT GBP H .....	-5.72%	-2.77%	9.02%	32.22%
BT HKD .....	-5.22%	-1.78%(a)	9.86%	161.14%
BT NZD H .....	-5.50%	-2.45%	9.20%	33.32%
C .....	-5.57%	-2.36%	10.15%	189.79%
C EUR .....	-0.51%	4.84%(a)	11.19%	144.04%
C2 .....	-5.45%	-2.15%	10.07%	132.50%
C2 EUR .....	-0.43%	5.34%(a)	11.22%	167.83%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
C2 EUR H	-5.80%	-2.91%	8.97%	24.40%
CK	-5.43%	-2.11%	10.08%	24.62%
CK EUR H	-5.87%	-2.99%	8.98%	9.15%
CT	-5.42%	-2.14%	10.03%	38.74%
EA	-5.44%	-2.12%	10.08%	6.43%
EA AUD H	-5.60%	-2.39%	9.55%	0.53%
EA ZAR H	-3.08%	2.65%	14.82%	15.65%
I	-4.81%	-1.10%	11.24%	295.12%
I EUR	0.30%	6.20%(a)	12.28%	209.96%
I2	-4.92%	-1.12%	11.14%	113.25%
I2 AUD H	-5.15%	-1.45%	10.66%	90.33%
I2 CHF H	-5.41%	-2.17%	9.76%	8.47%
I2 EUR	0.11%	6.40%(a)	12.35%	159.45%
I2 EUR H	-5.37%	-2.02%	10.05%	67.87%
I2 SGD	-4.12%	0.63%(a)	9.79%	69.93%
I2 SGD H	-4.98%	-1.16%	11.06%	24.73%
IA AUD H	-5.09%	-1.47%	10.59%	30.85%
IQD	-4.98%	-1.11%	11.21%	56.91%
IQD EUR	0.14%	6.46%(a)	12.35%	96.28%
IT	-5.03%	-1.24%	11.22%	33.98%
IT AUD H	-5.17%	-1.45%	10.62%	36.54%
IT CAD H	-4.99%	-1.32%	10.85%	29.47%
IT EUR H	-5.35%	-1.99%	10.03%	0.00%
IT GBP H	-5.02%	-1.33%	10.70%	25.72%
IT HKD	-4.52%	-0.46%(a)	11.59%	34.88%
IT NZD H	-4.84%	-1.07%	10.80%	33.99%
IT RMB H	-3.77%	1.55%	13.64%	53.29%
J	-5.70%	-2.77%	9.58%	173.89%
N2	-5.48%	-2.25%	9.99%	27.67%
NT	-5.43%	-2.19%	9.94%	27.82%
S1	-4.90%	-1.01%	11.30%	90.40%
S1 EUR	0.16%	6.57%(a)	12.47%	106.74%
S1D	-4.86%	-1.01%	11.33%	57.00%
SA	-4.47%	-0.12%	12.33%	41.37%
SHK	-4.46%	-0.18%	12.27%	40.25%
SK	-4.79%	-0.78%	11.62%	156.07%
W	-4.89%	-1.11%	11.11%	5.37%
W EUR	0.12%	6.37%(a)	12.28%	4.14%
W2	-4.92%	-1.03%	11.35%	9.47%
W2 CHF H	-5.30%	-2.05%	9.82%	-1.13%
W2 EUR H	-5.31%	-1.88%	10.33%	1.13%
WT	-4.93%	-1.12%	11.21%	9.46%
WT AUD H	-5.11%	-1.36%	10.75%	4.09%
WT CAD H	-4.92%	-1.12%	10.99%	3.07%
WT EUR H	-5.30%	-1.90%	10.03%	-0.09%
WT GBP H	-4.97%	-1.24%	10.84%	2.02%
WT RMB H	-3.70%	1.65%	13.72%	9.31%

**American Income Portfolio**

<b>Klasse</b>				
A	-4.90%	-2.92%	4.31%	391.18%
A EUR	0.05%	4.46%(a)	5.40%	119.93%
A2	-4.96%	-2.83%	4.39%	250.68%
A2 CHF H	-5.47%	-3.90%	3.12%	8.33%
A2 DUR PH	-2.44%	-1.08%	5.42%	22.67%
A2 EUR	0.07%	4.59%(a)	5.46%	118.10%
A2 EUR H	-5.37%	-3.68%	3.38%	29.13%
A2 HKD	-4.52%	-2.10%(a)	4.77%	113.50%
A2 PLN H	-4.51%	-2.55%	3.94%	4.99%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>American Income Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
A2 SGD .....	-4.16%	-1.07%(a)	3.15%	49.54%
A2 SGD H .....	-4.93%	-2.80%	4.25%	41.33%
AA .....	-5.02%	-2.85%	4.41%	29.27%
AA AUD H .....	-5.05%	-2.98%	4.01%	31.63%
AA CAD H .....	-4.96%	-2.91%	4.16%	19.89%
AA DUR PH .....	-2.47%	-1.04%	5.42%	21.71%
AA EUR H .....	-5.35%	-3.63%	3.37%	8.89%
AA GBP H .....	-5.10%	-3.05%	4.06%	15.17%
AA HKD .....	-4.52%	-2.09%(a)	4.76%	25.31%
AA NZD H .....	-4.87%	-2.81%	4.16%	29.94%
AA RMB H .....	-3.77%	-0.16%	6.73%	44.74%
AA SGD H .....	-4.95%	-2.80%	4.37%	23.93%
AA ZAR H .....	-2.55%	2.04%	9.13%	88.88%
AK .....	-4.96%	-2.86%	4.38%	28.20%
AK EUR .....	0.09%	4.54%(a)	5.37%	48.82%
AK EUR H .....	-5.43%	-3.70%	3.38%	12.36%
AR EUR .....	0.08%	4.59%	5.53%	23.26%
AR EUR H .....	-5.32%	-3.67%	3.38%	6.96%
AT .....	-5.02%	-2.91%	4.46%	170.24%
AT AUD H .....	-5.10%	-3.11%	3.99%	73.30%
AT CAD H .....	-5.00%	-2.93%	4.21%	43.32%
AT DUR PH .....	-2.41%	-1.03%	5.41%	22.62%
AT EUR .....	0.20%	4.63%(a)	5.42%	134.45%
AT EUR H .....	-5.41%	-3.69%	3.41%	30.90%
AT GBP H .....	-4.97%	-2.98%	3.97%	31.04%
AT HKD .....	-4.52%	-2.17%(a)	4.79%	113.45%
AT NZD H .....	-4.86%	-2.81%	4.09%	40.39%
AT RMB H .....	-3.76%	-0.15%	6.75%	65.57%
AT SGD .....	-4.13%	-1.13%(a)	3.18%	67.81%
AT SGD H .....	-4.95%	-2.82%	4.29%	41.27%
B .....	-5.25%	-3.62%	3.58%	300.84%
B2 .....	-5.29%	-3.51%	3.66%	194.17%
B2 HKD .....	-4.85%	-2.78%(a)	4.04%	94.98%
BA .....	-5.30%	-3.49%	3.72%	22.23%
BA AUD H .....	-5.44%	-3.84%	3.19%	23.97%
BT .....	-5.31%	-3.56%	3.60%	138.20%
BT AUD H .....	-5.40%	-3.76%	3.26%	60.43%
BT CAD H .....	-5.26%	-3.55%	3.39%	30.70%
BT EUR H .....	-5.68%	-4.38%	2.60%	20.62%
BT GBP H .....	-5.42%	-3.71%	3.32%	22.46%
BT HKD .....	-4.84%	-2.78%(a)	4.01%	95.06%
BT NZD H .....	-5.17%	-3.47%	3.44%	31.86%
C .....	-5.13%	-3.37%	3.84%	317.92%
C EUR .....	-0.18%	3.99%(a)	4.92%	96.72%
C2 .....	-5.18%	-3.29%	3.90%	316.96%
C2 DUR PH .....	-2.64%	-1.50%	4.97%	17.87%
C2 EUR .....	-0.18%	4.10%(a)	5.00%	97.66%
C2 EUR H .....	-5.59%	-4.11%	2.95%	22.80%
CT .....	-5.14%	-3.25%	3.87%	29.12%
EA .....	-5.21%	-3.32%	3.90%	6.30%
EA AUD H .....	-5.34%	-3.55%	3.42%	1.65%
EA ZAR H .....	-2.81%	1.52%	8.72%	17.77%
I .....	-4.63%	-2.38%	4.88%	279.03%
I EUR .....	0.32%	5.03%(a)	5.96%	146.18%
I2 .....	-4.74%	-2.35%	4.98%	121.85%
I2 AUD H .....	-4.86%	-2.60%	4.60%	9.67%
I2 CHF H .....	-5.16%	-3.34%	3.62%	14.00%
I2 DUR PH .....	-2.16%	-0.52%	5.98%	27.13%
I2 EUR .....	0.36%	5.11%(a)	6.00%	155.13%
I2 EUR H .....	-5.10%	-3.09%	3.99%	40.27%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>American Income Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
I2 HKD .....	-4.27%	-1.61%(a)	5.35%	29.56%
I2 SGD .....	-3.90%	-0.59%(a)	3.69%	58.04%
I2 SGD H .....	-4.66%	-2.26%	4.83%	26.87%
IA .....	-4.72%	-2.31%	4.93%	30.38%
IA AUD H .....	-4.87%	-2.55%	4.60%	27.77%
IT .....	-4.68%	-2.27%	4.92%	34.83%
IT AUD H .....	-4.86%	-2.55%	4.57%	36.30%
IT CAD H .....	-4.66%	-2.36%	4.64%	25.24%
IT EUR H .....	-5.14%	-3.14%	3.96%	15.05%
IT GBP H .....	-4.83%	-2.53%	4.64%	21.23%
IT HKD .....	-4.26%	-1.56%(a)	5.31%	35.22%
IT JPY .....	-0.42%	5.35%	9.00%	52.23%
IT JPY H .....	-4.91%	-2.74%	4.37%	16.61%
IT NZD H .....	-4.60%	-2.17%	4.78%	30.18%
IT RMB H .....	-3.50%	0.36%	7.27%	11.52%
IT SGD .....	-3.92%	-0.55%(a)	3.70%	22.72%
IT SGD H .....	-4.66%	-2.25%	4.87%	34.40%
J .....	-5.23%	-3.58%	3.60%	201.53%
L2 .....	-4.87%	-2.59%	4.64%	2.87%
L2 AUD H .....	-4.94%	-2.79%	4.30%	0.00%
L2 SGD H .....	-4.79%	-2.55%	4.56%	1.93%
LT .....	-4.87%	-2.59%	4.68%	2.86%
LT AUD H .....	-4.97%	-2.82%	4.25%	-0.04%
LT SGD H .....	-4.78%	-2.49%	4.54%	1.96%
N2 .....	-5.26%	-3.42%	3.80%	22.40%
NT .....	-5.24%	-3.39%	3.77%	22.38%
S .....	-4.37%	-1.59%	5.69%	44.40%
S1 .....	-4.62%	-2.11%	5.19%	61.07%
S1 EUR .....	0.47%	5.38%(a)	6.29%	95.91%
S1D .....	-4.60%	-2.13%	5.20%	47.48%
S1D2 .....	-4.61%	-2.08%	5.19%	0.38%
SA .....	-4.38%	-1.61%	5.72%	40.51%
SHK .....	-4.35%	-1.62%	5.67%	33.52%
W .....	-4.60%	-2.18%	5.06%	14.65%
W2 .....	-4.65%	-2.16%	5.12%	14.87%
W2 CHF H .....	-5.06%	-3.17%	3.80%	3.73%
W2 EUR H .....	-5.00%	-2.95%	4.14%	5.20%
WT .....	-4.65%	-2.15%	5.15%	14.88%
WT AUD H .....	-4.79%	-2.42%	4.71%	10.51%
WT EUR H .....	-5.02%	-2.94%	4.14%	2.37%
WT GBP H .....	-4.70%	-2.32%	4.80%	3.62%
WT HKD .....	-4.18%	-1.39%(a)	5.53%	14.81%
WT SGD H .....	-4.64%	-2.13%	5.01%	12.20%
<b>European Income Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	-4.67%	-3.10%	4.69%	112.49%
A USD .....	-9.52%	-10.01%(a)	3.59%	116.97%
A2 .....	-4.79%	-3.17%	4.73%	110.80%
A2 CHF H .....	-4.95%	-3.47%	4.37%	7.53%
A2 PLN H .....	-3.93%	-2.06%	5.24%	6.46%
A2 SGD H .....	-4.43%	-2.40%	5.56%	22.13%
A2 USD .....	-9.56%	-10.05%(a)	3.65%	118.28%
A2 USD H .....	-4.43%	-2.47%	5.58%	26.53%
AA .....	-4.78%	-3.18%	4.66%	19.87%
AA AUD H .....	-4.57%	-2.63%	5.32%	37.89%
AA HKD H .....	-4.49%	-2.61%	5.51%	27.57%
AA RMB H .....	-3.13%	0.10%	8.02%	43.06%
AA SGD H .....	-4.42%	-2.47%	5.50%	30.41%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>European Income Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
AA USD H . . . . .	-4.42%	-2.51%	5.62%	34.82%
AK . . . . .	-4.82%	-3.17%	4.72%	25.33%
AR . . . . .	-4.81%	-3.24%	4.65%	12.12%
AT . . . . .	-4.81%	-3.10%	4.84%	106.59%
AT AUD H . . . . .	-4.61%	-2.76%	5.25%	90.83%
AT SGD H . . . . .	-4.44%	-2.46%	5.55%	30.38%
AT USD . . . . .	-9.63%	-10.02%(a)	3.71%	54.20%
AT USD H . . . . .	-4.42%	-2.42%	5.63%	69.95%
B USD . . . . .	-9.86%	-10.67%(a)	2.86%	84.18%
B2 . . . . .	-5.16%	-3.90%	4.00%	80.00%
B2 USD . . . . .	-9.91%	-10.70%(a)	2.94%	83.21%
BA AUD H . . . . .	-4.87%	-3.34%	4.59%	30.50%
BA USD H . . . . .	-4.71%	-3.13%	4.84%	27.59%
BT . . . . .	-5.15%	-3.79%	4.11%	81.86%
BT AUD H . . . . .	-4.79%	-3.22%	4.52%	76.94%
BT USD H . . . . .	-4.77%	-3.17%	4.90%	56.90%
C . . . . .	-4.90%	-3.55%	4.21%	88.10%
C USD . . . . .	-9.74%	-10.44%(a)	3.12%	93.39%
C2 . . . . .	-5.02%	-3.63%	4.23%	98.90%
C2 USD . . . . .	-9.79%	-10.44%(a)	3.17%	106.00%
C2 USD H . . . . .	-4.64%	-2.90%	5.16%	20.47%
CK . . . . .	-5.00%	-3.64%	4.24%	20.68%
CT USD H . . . . .	-4.66%	-2.93%	5.18%	20.57%
I . . . . .	-4.41%	-2.57%	5.25%	141.18%
I USD . . . . .	-9.26%	-9.50%(a)	4.15%	223.83%
I2 . . . . .	-4.52%	-2.61%	5.32%	89.44%
I2 AUD H . . . . .	-4.30%	-2.15%	5.81%	103.40%
I2 CHF H . . . . .	-4.74%	-4.52%	3.35%	9.80%
I2 USD . . . . .	-9.36%	-9.57%(a)	4.22%	66.63%
I2 USD H . . . . .	-4.17%	-1.92%	6.24%	80.67%
IA . . . . .	-4.53%	-2.62%	5.31%	17.55%
IA HKD H . . . . .	-4.23%	-2.09%	6.07%	28.37%
IA SGD H . . . . .	-4.13%	-1.87%	6.13%	28.44%
IA USD H . . . . .	-4.13%	-1.91%	6.18%	32.10%
IT . . . . .	-4.56%	-2.68%	5.29%	17.42%
IT SGD H . . . . .	-4.15%	-1.86%	6.16%	28.57%
IT USD H . . . . .	-4.17%	-1.91%	6.25%	34.66%
NT USD H . . . . .	-4.68%	-2.93%	5.07%	13.37%
S1 . . . . .	-4.45%	-2.44%	5.52%	68.75%
S1 USD . . . . .	-9.24%	-9.36%(a)	4.40%	40.30%
S1 USD H . . . . .	-4.08%	-1.74%	6.43%	69.40%
S1D . . . . .	-4.43%	-2.41%	5.51%	19.59%
SA USD H . . . . .	-3.82%	-1.24%	6.94%	47.65%
SHK . . . . .	-4.18%	-1.97%	6.02%	23.02%
W2 . . . . .	-4.44%	-2.49%	5.41%	1.80%
W2 CHF H . . . . .	-4.63%	-2.82%	5.12%	5.73%
W2 USD H . . . . .	-4.07%	-1.74%	6.40%	5.27%
WA . . . . .	-4.46%	-2.48%	5.46%	1.78%
WA HKD H . . . . .	-4.12%	-1.90%	6.25%	5.15%
WA USD H . . . . .	-4.05%	-1.76%	6.32%	5.24%
WT . . . . .	-4.49%	-2.51%	5.45%	1.78%
WT SGD H . . . . .	-4.06%	-1.68%	6.33%	4.40%
WT USD H . . . . .	-4.08%	-1.73%	6.46%	5.30%
<b>Emerging Markets Debt Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A . . . . .	-13.25%	-9.78%	5.90%	108.09%
A EUR . . . . .	-8.71%	-2.97%(a)	7.04%	122.21%
A2 . . . . .	-13.32%	-9.76%	6.01%	109.07%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
A2 CHF H .....	-13.79%	-10.81%	4.57%	-5.40%
A2 EUR .....	-8.75%	-2.88%(a)	7.10%	123.32%
A2 EUR H .....	-13.81%	-10.68%	4.84%	28.20%
A2 HKD .....	-12.91%	-9.08%(a)	6.38%	57.39%
A2 PLN .....	-5.00%	-2.56%(a)(b)	–	-2.56%
A2 PLN H .....	-13.19%	-9.98%	4.99%	-4.43%
A2 SGD H .....	-13.34%	-9.83%	5.79%	30.80%
AA .....	-13.33%	-9.78%	6.02%	20.60%
AA AUD H .....	-13.41%	-10.04%	5.38%	19.85%
AA CAD H .....	-13.30%	-9.84%	5.54%	7.55%
AA EUR H .....	-13.79%	-10.74%	4.76%	-1.25%
AA GBP H .....	-13.42%	-10.04%	5.35%	3.76%
AA HKD .....	-12.91%	-9.10%(a)	6.40%	14.91%
AA NZD H .....	-13.15%	-9.68%	5.63%	15.59%
AA RMB H .....	-12.19%	-7.29%	8.25%	34.39%
AA SGD H .....	-13.32%	-9.75%	5.84%	14.97%
AA ZAR H .....	-11.14%	-5.40%	10.48%	71.63%
AI .....	-13.36%	-9.56%(3)	–	-9.56%
AI AUD H .....	-13.39%	-9.82%(3)	–	-9.82%
AR EUR .....	-8.67%	-2.84%	7.10%	16.77%
AT .....	-13.32%	-9.80%	5.99%	108.90%
AT AUD H .....	-13.41%	-10.04%	5.32%	62.97%
AT CAD H .....	-13.34%	-9.85%	5.62%	8.82%
AT EUR .....	-8.75%	-2.93%(a)	7.13%	117.72%
AT EUR H .....	-13.82%	-10.69%	4.82%	28.51%
AT GBP H .....	-13.36%	-9.96%	5.36%	4.90%
AT HKD .....	-12.91%	-9.09%(a)	6.39%	57.39%
AT NZD H .....	-13.19%	-9.74%	5.55%	21.72%
AT RMB H .....	-12.16%	-7.24%	8.23%	55.28%
AT SGD H .....	-13.33%	-9.82%	5.81%	30.72%
B2 HKD .....	-13.34%	-9.98%(a)	5.33%	39.20%
BT .....	-13.76%	-10.70%	4.92%	78.10%
BT EUR H .....	-14.25%	-11.53%	3.91%	14.72%
BT HKD .....	-13.34%	-9.99%(a)	5.33%	39.23%
C .....	-13.52%	-10.21%	5.50%	93.85%
C EUR .....	-8.91%	-3.41%(a)	6.56%	107.04%
C2 .....	-13.52%	-10.17%	5.51%	94.40%
C2 EUR .....	-8.93%	-3.31%(a)	6.57%	107.67%
C2 EUR H .....	-14.04%	-11.12%	4.41%	22.00%
CT .....	-13.51%	-10.16%	5.53%	9.33%
EA .....	-13.53%	-10.23%	5.42%	-6.46%
EA AUD H .....	-13.56%	-10.43%	4.74%	-9.88%
EA ZAR H .....	-11.35%	-5.88%	9.98%	1.73%
EI .....	-13.55%	-10.03%(3)	–	-10.03%
EI AUD H .....	-13.62%	-10.27%(3)	–	-10.27%
I .....	-13.06%	-9.21%	6.56%	126.98%
I2 .....	-13.08%	-9.26%	6.58%	128.07%
I2 CHF H .....	-13.55%	-10.33%	5.11%	-0.47%
I2 EUR .....	-8.46%	-2.31%(a)	7.69%	143.69%
I2 EUR H .....	-13.55%	-10.20%	5.44%	37.40%
IT AUD H .....	-13.17%	-9.53%	6.01%	20.70%
IT EUR H .....	-13.56%	-10.22%	5.41%	2.39%
IT SGD H .....	-13.11%	-9.29%	6.42%	15.41%
N2 .....	-13.60%	-10.28%	5.42%	7.60%
NT .....	-13.51%	-10.25%	5.44%	7.70%
S .....	-12.80%	-8.66%	7.33%	61.70%
S EUR H .....	-13.25%	-9.52%	6.24%	41.87%
S GBPH .....	-12.85%	-8.84%	6.80%	50.60%
S1 2 .....	-13.03%	-9.15%	6.72%	111.73%
S1 2 EUR .....	-8.41%	-2.18%(a)	7.85%	166.01%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<b>Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
S1 EUR H .....	-13.50%	-10.06%	5.69%	111.73%
S1 GBP H .....	-13.05%	-9.33%	6.19%	41.20%
SA .....	-12.80%	-8.65%	7.32%	30.71%
<b>Mortgage Income Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	-1.00%	0.84%	7.58%	20.47%
A2 .....	-1.04%	0.89%	7.63%	20.93%
A2 EUR .....	4.19%	8.52%(a)	8.76%	47.94%
A2 HKD .....	-0.57%	1.67%(a)	8.04%	6.63%
A2 SGD .....	-0.24%	2.67%(a)	6.38%	29.80%
A2X .....	-1.07%	0.93%	7.71%	36.59%
A2X EUR .....	4.23%	8.72%(a)	8.81%	7.71%
AA .....	-1.12%	0.85%	7.61%	20.86%
AA AUD H .....	-1.17%	0.56%	7.13%	22.71%
AA HKD .....	-0.59%	1.64%(a)	7.96%	19.10%
AA RMB H .....	0.21%	3.69%	10.06%	32.98%
AA SGD H .....	-0.98%	0.98%	7.52%	18.37%
AA ZAR H .....	1.54%	5.98%	12.60%	80.63%
AR EUR H .....	-1.38%	0.11%	6.65%	2.91%
AT .....	-1.07%	0.87%	7.60%	20.76%
AT AUD H .....	-1.17%	0.65%	7.20%	22.78%
AT EUR .....	4.20%	8.54%(a)	8.72%	47.82%
AT GBP H .....	-1.14%	0.68%	7.28%	-1.52%
AT HKD .....	-0.58%	1.64%(a)	8.00%	6.53%
AT SGD .....	-0.22%	2.72%(a)	6.34%	29.71%
AT SGD H .....	-1.11%	0.82%	7.61%	18.07%
AX .....	-0.91%	0.95%	7.75%	77.10%
AX EUR .....	4.09%	8.39%(a)	8.91%	29.48%
BX .....	-1.13%	0.49%	7.25%	56.35%
BX EUR .....	3.87%	7.93%(a)	8.42%	-6.66%
C .....	-1.30%	0.39%	7.17%	16.20%
C2 .....	-1.24%	0.40%	7.15%	16.47%
C2 EUR .....	4.01%	8.04%(a)	8.24%	42.54%
CX .....	-1.13%	0.49%	7.25%	56.22%
I .....	-0.81%	1.40%	8.19%	26.05%
I EUR .....	4.49%	9.13%(a)	9.22%	54.11%
I2 .....	-0.79%	1.45%	8.21%	26.33%
I2 EUR .....	4.51%	9.17%(a)	9.33%	54.62%
I2 EUR H .....	-1.14%	0.61%	7.18%	-1.60%
I2X .....	-0.77%	1.48%	8.30%	26.46%
IT EUR H .....	-1.18%	0.58%	7.21%	-2.23%
IX .....	-0.63%	1.50%	8.36%	73.31%
N2 .....	-1.36%	0.26%	7.08%	1.40%
NT .....	-1.35%	0.28%	7.05%	1.52%
S .....	-0.46%	2.18%	9.08%	33.83%
S1 .....	-0.68%	1.61%	8.42%	28.62%
S1 EUR .....	4.59%	9.39%(a)	9.54%	57.09%
S1 EUR H .....	-1.06%	0.81%	7.41%	-3.49%
S1 JPY .....	3.77%	9.58%	12.62%	6.79%
S1X .....	-0.50%	1.77%	8.65%	38.85%
SA .....	-0.46%	2.10%	8.97%	30.83%

Die Wertentwicklung der Anteilsklassen der einzelnen Portefeuilles basiert auf dem Nettoinventarwert zum 28. Februar 2022, 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 Anteilsklassen 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 28. Februar 2022.

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

Rendite berechnet ab Auflegungsdatum am:

- (1) 26. Oktober 2021. Die Anteilklasse wurde am 4. Oktober 2021 vollständig zurückgenommen und am 26. Oktober 2021 neu aufgelegt.
- (2) 15. Februar 2022
- (3) 4. März 2021

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN</b>			
<b>DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Charter Communications, Inc. - Class A	188	\$ 113,135	0.3%
Comcast Corp. - Class A	5,473	255,917	0.6
Deutsche Telekom AG (REG)	3,920	70,265	0.2
Liberty Global PLC	270	6,985	0.0
Spark New Zealand Ltd.	5,208	15,990	0.0
Telefonica SA	12,788	61,074	0.2
		<u>523,366</u>	<u>1.3</u>
<b>UNTERHALTUNG</b>			
Electronic Arts, Inc.	1,481	192,664	0.5
Netflix, Inc.	22	8,679	0.0
Walt Disney Co. (The)	905	134,356	0.3
		<u>335,699</u>	<u>0.8</u>
<b>INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Alphabet, Inc. - Class A	40	108,046	0.3
Alphabet, Inc. - Class C	122	329,134	0.8
Meta Platforms, Inc. - Class A	1,741	367,403	0.9
		<u>804,583</u>	<u>2.0</u>
<b>MEDIEN</b>			
Fox Corp. - Class A	1,046	43,754	0.1
<b>DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
SoftBank Group Corp.	1,050	47,120	0.1
		<u>1,754,522</u>	<u>4.3</u>
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>KFZ-BESTANDTEILE</b>			
Aptiv PLC	1,482	191,830	0.5
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	3,330	51,582	0.1
Magna International, Inc. - Class A (United States)	42	3,120	0.0
		<u>246,532</u>	<u>0.6</u>
<b>KRAFTFAHRZEUGE</b>			
Stellantis NV	3,915	71,405	0.2
Tesla, Inc.	98	85,302	0.2
Volkswagen AG	42	10,863	0.0
		<u>167,570</u>	<u>0.4</u>
<b>DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE</b>			
Service Corp. International/US	1,046	63,649	0.1
<b>HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT</b>			
Booking Holdings, Inc.	63	136,852	0.3
Chipotle Mexican Grill, Inc. - Class A	33	50,271	0.1
Compass Group PLC	2,696	60,938	0.2
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	704	40,650	0.1
Domino's Pizza, Inc.	121	52,297	0.1
Entain PLC	3,310	74,417	0.2
Galaxy Entertainment Group Ltd.	17,000	94,813	0.2
Starbucks Corp.	366	33,595	0.1
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	21,200	39,484	0.1
		<u>583,317</u>	<u>1.4</u>
<b>HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER</b>			
Electrolux AB	974	17,440	0.1
PulteGroup, Inc.	1,773	88,047	0.2
		<u>105,487</u>	<u>0.3</u>
<b>EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB</b>			
Alibaba Group Holding Ltd.	800	10,531	0.0
Alibaba Group Holding Ltd. (ADR)	656	69,005	0.2
Amazon.com, Inc.	149	457,617	1.1
Prosus NV	1,862	115,596	0.3
		<u>652,749</u>	<u>1.6</u>
<b>MULTILINE-EINZELHANDEL</b>			
Cie Financiere Richemont SA	35	4,687	0.0
Dollarama, Inc.	161	8,320	0.0
Target Corp.	86	17,180	0.1
		<u>30,187</u>	<u>0.1</u>
<b>SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL</b>			
AutoZone, Inc.	29	54,038	0.2
Home Depot, Inc. (The)	278	87,801	0.2

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
TJX Cos., Inc. (The) .....	2,589	\$ 171,133	0.4%
Zhongsheng Group Holdings Ltd. ....	6,000	41,898	0.1
		<u>354,870</u>	<u>0.9</u>
<b>TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER</b>			
adidas AG .....	134	31,683	0.1
Carter's, Inc. ....	720	69,610	0.1
Hermes International .....	11	15,169	0.0
Kering SA .....	48	33,295	0.1
NIKE, Inc. - Class B .....	1,135	154,984	0.4
Pandora A/S .....	420	43,007	0.1
Tapestry, Inc. ....	1,870	76,483	0.2
		<u>424,231</u>	<u>1.0</u>
		<u>2,628,592</u>	<u>6.4</u>
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>			
<b>GETRÄNKE</b>			
Asahi Group Holdings Ltd. ....	3,120	125,859	0.3
Coca-Cola Co. (The) .....	3,686	229,417	0.6
Constellation Brands, Inc. - Class A .....	557	120,100	0.3
		<u>475,376</u>	<u>1.2</u>
<b>LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL</b>			
Atacadao SA .....	12,800	47,183	0.1
Costco Wholesale Corp. ....	140	72,695	0.2
Koninklijke Ahold Delhaize NV .....	1,256	38,637	0.1
Kroger Co. (The) .....	1,349	63,133	0.1
		<u>221,648</u>	<u>0.5</u>
<b>LEBENSMITTELPRODUKTE</b>			
Bunge Ltd. ....	467	48,825	0.1
Hain Celestial Group, Inc. (The) .....	1,960	71,266	0.2
Hershey Co. (The) .....	259	52,385	0.1
Nestle SA .....	1,805	235,184	0.6
Nichirei Corp. ....	2,000	44,072	0.1
Nomad Foods Ltd. ....	1,980	49,856	0.1
Salmar ASA .....	720	52,902	0.1
Tyson Foods, Inc. - Class A .....	655	60,692	0.2
		<u>615,182</u>	<u>1.5</u>
<b>KÖRPERPFLEGEPRODUKTE</b>			
Estee Lauder Cos., Inc. (The) - Class A .....	201	59,562	0.1
		<u>1,371,768</u>	<u>3.3</u>
<b>ENERGIE</b>			
<b>ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE</b>			
Baker Hughes Co. - Class A .....	2,141	62,903	0.2
Halliburton Co. ....	1,072	35,944	0.1
		<u>98,847</u>	<u>0.3</u>
<b>ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE</b>			
BP PLC .....	15,646	76,260	0.2
Canadian Natural Resources Ltd. ....	535	29,888	0.1
Marathon Petroleum Corp. ....	867	67,513	0.1
Neste Oyj .....	650	25,346	0.1
OMV AG .....	648	30,847	0.1
Pioneer Natural Resources Co. ....	115	27,554	0.1
Shell PLC .....	10,897	287,953	0.6
Suncor Energy, Inc. ....	84	2,569	0.0
		<u>547,930</u>	<u>1.3</u>
		<u>646,777</u>	<u>1.6</u>
<b>FINANZWERTE</b>			
<b>BANKEN</b>			
ABN AMRO Bank NV (GDR) .....	2,517	33,494	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA .....	6,294	37,347	0.1
Bank Leumi Le-Israel BM .....	5,630	60,989	0.2
Bank of America Corp. ....	1,740	76,908	0.2
Bank of Ireland Group PLC .....	14,310	94,859	0.2
Citigroup, Inc. ....	818	48,450	0.1
Grupo Financiero Banorte SAB de CV - Class O .....	12,420	84,286	0.2
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A .....	14,300	50,098	0.1
ING Groep NV .....	1,923	22,458	0.1
JPMorgan Chase & Co. ....	588	83,379	0.2
Jyske Bank A/S .....	345	18,704	0.0
KB Financial Group, Inc. ....	1,430	70,548	0.2
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. ....	9,100	55,865	0.1
National Bank of Canada .....	748	59,976	0.1

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Nordea Bank Abp	6,900	\$ 76,338	0.2%
Regions Financial Corp.	1,806	43,687	0.1
Societe Generale SA	1,601	45,272	0.1
SVB Financial Group	19	11,514	0.0
Toronto-Dominion Bank (The)	919	74,158	0.2
Wells Fargo & Co.	1,960	104,605	0.3
		<u>1,152,935</u>	<u>2.8</u>
<b>KAPITALMÄRKTE</b>			
Ameriprise Financial, Inc.	201	60,258	0.2
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	13,500	37,981	0.1
BlackRock, Inc. - Class A	100	74,389	0.2
Carlyle Group, Inc. (The)	1,229	57,603	0.1
Charles Schwab Corp. (The)	3,403	287,417	0.7
Credit Suisse Group AG (REG)	12,770	106,976	0.3
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	528	180,201	0.4
Julius Baer Group Ltd.	1,544	90,411	0.2
London Stock Exchange Group PLC	661	57,743	0.1
Moody's Corp.	225	72,457	0.2
MSCI, Inc. - Class A	70	35,118	0.1
		<u>1,060,554</u>	<u>2.6</u>
<b>FINANZWESEN – VERBRAUCHER</b>			
Ally Financial, Inc.	1,208	60,279	0.1
American Express Co.	338	65,755	0.2
		<u>126,034</u>	<u>0.3</u>
<b>DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN</b>			
Groupe Bruxelles Lambert SA	299	31,047	0.1
Investor AB - Class B	2,697	54,917	0.1
Kinnevik AB	958	24,391	0.1
		<u>110,355</u>	<u>0.3</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>			
AIA Group Ltd.	13,400	139,144	0.4
Fidelity National Financial, Inc.	1,171	55,786	0.1
Japan Post Holdings Co., Ltd.	2,100	17,358	0.1
Japan Post Insurance Co., Ltd.	3,200	54,652	0.1
Medibank Pvt Ltd.	24,440	56,371	0.1
Prudential Financial, Inc.	339	37,853	0.1
Suncorp Group Ltd.	11,340	88,211	0.2
		<u>449,375</u>	<u>1.1</u>
		<u>2,899,253</u>	<u>7.1</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
<b>BIOTECHNOLOGIE</b>			
AbbVie, Inc.	253	37,386	0.1
Genmab A/S	384	129,061	0.3
Moderna, Inc.	19	2,918	0.0
		<u>169,365</u>	<u>0.4</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF</b>			
Abbott Laboratories	1,389	167,541	0.4
IDEXX Laboratories, Inc.	108	57,494	0.1
Intuitive Surgical, Inc.	106	30,775	0.1
Koninklijke Philips NV	5,458	186,438	0.4
Medtronic PLC	1,992	209,140	0.5
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	550	69,955	0.2
		<u>721,343</u>	<u>1.7</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
AmerisourceBergen Corp. - Class A	238	33,922	0.1
Anthem, Inc.	489	220,955	0.5
Centene Corp.	820	67,748	0.2
Molina Healthcare, Inc.	215	65,977	0.1
UnitedHealth Group, Inc.	9	4,283	0.0
		<u>392,885</u>	<u>0.9</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE</b>			
Change Healthcare, Inc.	3,269	70,022	0.2
<b>LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A	80	50,077	0.1
IQVIA Holdings, Inc.	757	174,201	0.4
Lonza Group AG	177	122,467	0.3
Mettler-Toledo International, Inc.	43	60,576	0.2
Thermo Fisher Scientific, Inc.	125	68,000	0.2
Waters Corp.	157	49,726	0.1
		<u>525,047</u>	<u>1.3</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>PHARMAZEUTIKA</b>			
AstraZeneca PLC (Sponsored ADR) .....	1,010	\$ 61,489	0.2%
Eli Lilly & Co. ....	321	80,234	0.2
Johnson & Johnson .....	382	62,866	0.2
Merck & Co., Inc. ....	736	56,363	0.1
Novo Nordisk A/S - Class B .....	795	82,269	0.2
Pfizer, Inc. ....	1,664	78,108	0.2
Roche Holding AG .....	908	343,890	0.8
Sanofi .....	1,332	139,238	0.3
Sumitomo Dainippon Pharma Co., Ltd. ....	2,000	21,949	0.1
Zoetis, Inc. ....	866	167,701	0.4
		<u>1,094,107</u>	<u>2.7</u>
		<u>2,972,769</u>	<u>7.2</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>			
<b>LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG</b>			
Airbus SE .....	611	78,012	0.2
Huntington Ingalls Industries, Inc. ....	297	60,707	0.1
		<u>138,719</u>	<u>0.3</u>
<b>LUFTFRACHT UND LOGISTIK</b>			
Kuehne & Nagel International AG .....	170	46,362	0.1
XPO Logistics, Inc. ....	1,070	77,767	0.2
		<u>124,129</u>	<u>0.3</u>
<b>BAUPRODUKTE</b>			
Cie de Saint-Gobain .....	62	3,844	0.0
Otis Worldwide Corp. ....	2,459	192,614	0.5
		<u>196,458</u>	<u>0.5</u>
<b>GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF</b>			
ADT, Inc. ....	8,556	62,544	0.1
Copart, Inc. ....	174	21,381	0.1
MillerKnoll, Inc. ....	1,130	43,935	0.1
TOPPAN, INC. ....	1,900	37,438	0.1
		<u>165,298</u>	<u>0.4</u>
<b>BAU- UND INGENIEURWESEN</b>			
AECOM .....	880	63,941	0.2
Dycom Industries, Inc. ....	530	46,142	0.1
Epiroc AB - Class A .....	646	12,138	0.0
		<u>122,221</u>	<u>0.3</u>
<b>ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG</b>			
Nidec Corp. ....	1,630	141,702	0.3
Regal Rexnord Corp. ....	510	81,778	0.2
Rockwell Automation, Inc. ....	189	50,384	0.1
Vertiv Holdings Co. ....	2,008	26,144	0.1
		<u>300,008</u>	<u>0.7</u>
<b>INDUSTRIEKONZERNE</b>			
Toshiba Corp. ....	900	35,883	0.1
<b>MASCHINEN</b>			
Alstom SA .....	4,509	114,709	0.3
Amada Co., Ltd. ....	5,100	45,190	0.1
Dover Corp. ....	595	93,332	0.2
Mitsubishi Heavy Industries Ltd. ....	2,200	64,884	0.2
Oshkosh Corp. ....	690	76,617	0.2
Parker-Hannifin Corp. ....	328	97,216	0.2
Snap-on, Inc. ....	196	41,195	0.1
Techtronic Industries Co., Ltd. ....	2,500	41,890	0.1
Volvo AB - Class B .....	2,832	54,470	0.1
		<u>629,503</u>	<u>1.5</u>
<b>PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Booz Allen Hamilton Holding Corp. ....	683	55,111	0.1
Recruit Holdings Co., Ltd. ....	3,310	139,715	0.3
Robert Half International, Inc. ....	1,006	121,012	0.3
Verisk Analytics, Inc. - Class A .....	570	101,084	0.3
		<u>416,922</u>	<u>1.0</u>
<b>STRASSE UND SCHIENE</b>			
NIPPON EXPRESS HOLDINGS, Inc. ....	1,000	60,620	0.2
<b>HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER</b>			
Air Lease Corp. ....	1,600	66,816	0.2
Ashtead Group PLC .....	2,727	177,206	0.4
Ferguson PLC .....	459	69,942	0.2
United Rentals, Inc. ....	7	2,251	0.0

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
WW Grainger, Inc. ....	104	\$ 49,614	0.1%
		<u>365,829</u>	<u>0.9</u>
		<u>2,555,590</u>	<u>6.2</u>
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG</b>			
Juniper Networks, Inc. ....	1,829	61,802	0.2
Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B ....	1,283	<u>11,806</u>	<u>0.0</u>
		<u>73,608</u>	<u>0.2</u>
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
Arrow Electronics, Inc. ....	488	59,477	0.1
IPG Photonics Corp. ....	199	25,940	0.1
Murata Manufacturing Co., Ltd. ....	1,920	<u>130,493</u>	<u>0.3</u>
		<u>215,910</u>	<u>0.5</u>
<b>INTERNET-SOFTWARE UND -DIENSTE</b>			
eBay, Inc. ....	1,040	<u>56,774</u>	<u>0.1</u>
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Accenture PLC - Class A ....	228	72,052	0.2
Akamai Technologies, Inc. ....	892	96,568	0.2
Automatic Data Processing, Inc. ....	925	189,107	0.5
Capgemini SE ....	1,118	234,030	0.6
Cognizant Technology Solutions Corp. - Class A ....	1,851	159,427	0.4
Gartner, Inc. ....	212	59,449	0.2
Mastercard, Inc. - Class A ....	769	277,471	0.7
Nihon Unisys Ltd. ....	1,700	46,573	0.1
PayPal Holdings, Inc. ....	1,206	134,988	0.3
Visa, Inc. - Class A ....	1,198	258,912	0.6
Western Union Co. (The) - Class W ....	890	<u>16,180</u>	<u>0.0</u>
		<u>1,544,757</u>	<u>3.8</u>
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>			
Advanced Micro Devices, Inc. ....	578	71,290	0.2
Applied Materials, Inc. ....	873	117,157	0.3
ASM International NV ....	110	35,526	0.1
ASML Holding NV ....	323	216,095	0.5
Broadcom, Inc. ....	118	69,318	0.2
Infineon Technologies AG ....	910	30,791	0.1
Novatek Microelectronics Corp. ....	2,880	47,746	0.1
NVIDIA Corp. ....	355	86,567	0.2
NXP Semiconductors NV ....	260	49,431	0.1
ON Semiconductor Corp. ....	860	53,845	0.1
QUALCOMM, Inc. ....	471	81,007	0.2
STMicroelectronics NV ....	763	32,029	0.1
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. ....	2,500	<u>53,749</u>	<u>0.1</u>
		<u>944,551</u>	<u>2.3</u>
<b>SOFTWARE</b>			
ACI Worldwide, Inc. ....	1,480	49,610	0.1
Adobe, Inc. ....	137	64,072	0.2
CommVault Systems, Inc. ....	1,221	76,813	0.2
Constellation Software, Inc./Canada ....	19	32,021	0.1
Fortinet, Inc. ....	130	44,788	0.1
Microsoft Corp. ....	2,879	860,217	2.1
NortonLifeLock, Inc. ....	3,579	103,719	0.2
Oracle Corp. ....	1,670	126,870	0.3
SAP SE ....	1,752	197,633	0.5
ServiceNow, Inc. ....	121	70,170	0.2
Trade Desk, Inc. (The) - Class A ....	376	32,080	0.1
VMware, Inc. - Class A ....	491	<u>57,604</u>	<u>0.1</u>
		<u>1,715,597</u>	<u>4.2</u>
<b>TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE</b>			
Apple, Inc. ....	2,006	331,231	0.8
NetApp, Inc. ....	701	54,944	0.1
Samsung Electronics Co., Ltd. ....	4,541	273,611	0.7
Western Digital Corp. ....	1,980	<u>100,861</u>	<u>0.2</u>
		<u>760,647</u>	<u>1.8</u>
		<u>5,311,844</u>	<u>12.9</u>
<b>GRUNDSTOFFE</b>			
<b>CHEMIKALIEN</b>			
Celanese Corp. - Class A ....	150	20,892	0.1
International Flavors & Fragrances, Inc. ....	879	116,907	0.3
Linde PLC ....	345	101,168	0.3
Mitsubishi Chemical Holdings Corp. ....	5,600	39,781	0.1

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %	
Mosaic Co. (The) . . . . .			846	\$ 44,356	0.1%	
Sumitomo Chemical Co., Ltd. . . . .			11,500	54,904	0.1	
Tosoh Corp. . . . .			4,400	68,279	0.1	
				<u>446,287</u>	<u>1.1</u>	
<b>METALL UND BERGBAU</b>						
ArcelorMittal SA . . . . .			2,440	75,710	0.2	
BlueScope Steel Ltd. . . . .			1,515	22,434	0.1	
Endeavour Mining PLC . . . . .			2,288	60,555	0.1	
Fortescue Metals Group Ltd. . . . .			475	6,328	0.0	
Norsk Hydro ASA . . . . .			6,050	57,451	0.1	
				<u>222,478</u>	<u>0.5</u>	
<b>PAPIER- UND HOLZPRODUKTE</b>						
Oji Holdings Corp. . . . .			3,400	17,371	0.1	
				<u>686,136</u>	<u>1.7</u>	
<b>IMMOBILIEN</b>						
<b>AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)</b>						
American Tower Corp. . . . .			451	102,318	0.2	
Americold Realty Trust . . . . .			2,340	62,525	0.2	
Equity LifeStyle Properties, Inc. . . . .			650	48,503	0.1	
Iron Mountain, Inc. . . . .			701	34,475	0.1	
Prologis, Inc. . . . .			370	53,965	0.1	
Weyerhaeuser Co. . . . .			91	3,538	0.0	
				<u>305,324</u>	<u>0.7</u>	
<b>IMMOBILIENENTWICKLUNG</b>						
CIFI Holdings Group Co., Ltd. . . . .			101,000	70,368	0.2	
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG</b>						
CBRE Group, Inc. - Class A . . . . .			978	94,719	0.2	
Nomura Real Estate Holdings, Inc. . . . .			2,500	62,247	0.2	
				<u>156,966</u>	<u>0.4</u>	
				<u>532,658</u>	<u>1.3</u>	
<b>VERSORGUNG</b>						
<b>STROMVERSORGUNGSBETRIEBE</b>						
EDP - Energias de Portugal SA . . . . .			19,231	93,894	0.2	
Enel SpA . . . . .			10,760	79,290	0.2	
Iberdrola SA . . . . .			4,835	54,856	0.2	
NRG Energy, Inc. . . . .			1,139	43,100	0.1	
				<u>271,140</u>	<u>0.7</u>	
<b>GASVERSORGUNGSBETRIEBE</b>						
China Resources Gas Group Ltd. . . . .			9,500	43,633	0.1	
Kunlun Energy Co., Ltd. . . . .			80,000	78,695	0.2	
UGI Corp. . . . .			1,279	49,165	0.1	
				<u>171,493</u>	<u>0.4</u>	
<b>UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN</b>						
Uniper SE . . . . .			351	11,229	0.0	
				<u>453,862</u>	<u>1.1</u>	
				<u>21,813,771</u>	<u>53.1</u>	
<b>REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE</b>						
<b>AUSTRALIEN</b>						
Australia Government Bond, Series 142 . . . . .	4.25%	04/21/2026	AUD	140	111,737	0.3
Australia Government Bond, Series 144 . . . . .	3.75%	04/21/2037		95	80,741	0.2
Australia Government Bond, Series 145 . . . . .	2.75%	06/21/2035		140	106,692	0.2
Australia Government Bond, Series 150 . . . . .	3.00%	03/21/2047		140	107,572	0.3
Australia Government Bond, Series 156 . . . . .	2.75%	05/21/2041		200	148,591	0.4
Australia Government Bond, Series 162 . . . . .	1.75%	06/21/2051		30	17,652	0.0
Australia Government Bond, Series 163 . . . . .	1.00%	11/21/2031		235	153,161	0.4
					<u>726,146</u>	<u>1.8</u>
<b>ÖSTERREICH</b>						
Republic of Austria Government Bond . . . . .	0.00%	02/20/2030	EUR	53	57,389	0.2
Republic of Austria Government Bond . . . . .	0.00%	02/20/2031		120	128,383	0.3
					<u>185,772</u>	<u>0.5</u>
<b>KANADA</b>						
Canadian Government Bond . . . . .	2.00%	12/01/2051	CAD	180	138,221	0.3
<b>DEUTSCHLAND</b>						
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe . . . . .	0.00%	02/15/2032	EUR	67	73,944	0.2
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe . . . . .	0.00%	08/15/2050		185	185,135	0.4
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series G . . . . .	0.00%	08/15/2031		26	29,244	0.1
					<u>288,323</u>	<u>0.7</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>INDONESIEN</b>					
Indonesia Treasury Bond, Series FR87	6.50%	02/15/2031	IDR 645,000	\$ 44,850	0.1%
<b>IRLAND</b>					
Ireland Government Bond	0.00%	10/18/2031	EUR 111	116,522	0.3
Ireland Government Bond	1.35%	03/18/2031	58	69,885	0.2
				<u>186,407</u>	<u>0.5</u>
<b>ITALIEN</b>					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	0.25%	03/15/2028	230	244,363	0.6
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	0.50%	07/15/2028	83	89,026	0.2
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	0.95%	09/15/2027	53	59,182	0.1
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1.50%	04/30/2045	34	33,094	0.1
				<u>425,665</u>	<u>1.0</u>
<b>JAPAN</b>					
Japan Government Five Year Bond, Series 133	0.10%	09/20/2022	JPY 49,550	431,418	1.1
Japan Government Ten Year Bond, Series 358	0.10%	03/20/2030	32,300	281,291	0.7
Japan Government Ten Year Bond, Series 360	0.10%	09/20/2030	11,450	99,511	0.2
Japan Government Thirty Year Bond, Series 65	0.40%	12/20/2049	11,350	87,561	0.2
Japan Government Thirty Year Bond, Series 68	0.60%	09/20/2050	9,250	75,074	0.2
Japan Government Twenty Year Bond, Series 171	0.30%	12/20/2039	10,350	85,760	0.2
Japan Government Twenty Year Bond, Series 177	0.40%	06/20/2041	17,650	146,876	0.4
Japan Government Two Year Bond, Series 412	0.10%	05/01/2022	25,450	221,438	0.5
Japan Government Two Year Bond, Series 423	0.01%	04/01/2023	35,100	305,525	0.7
Japan Government Two Year Bond, Series 424	0.01%	05/01/2023	8,550	74,427	0.2
Japan Government Two Year Bond, Series 433	0.01%	02/01/2024	8,650	75,305	0.2
Japan Treasury Discount Bill, Series 1051	0.00%	04/18/2022	13,150	114,397	0.3
				<u>1,998,583</u>	<u>4.9</u>
<b>MALAYSIA</b>					
Malaysia Government Bond, Series 310	4.50%	04/15/2030	MYR 245	61,359	0.1
<b>SPANIEN</b>					
Spain Government Bond	1.00%	07/30/2042	EUR 161	161,764	0.4
Spain Government Bond	1.20%	10/31/2040	18	18,905	0.0
				<u>180,669</u>	<u>0.4</u>
<b>THAILAND</b>					
Thailand Government Bond	1.59%	12/17/2035	THB 1,100	29,889	0.1
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					
United Kingdom Gilt	0.88%	01/31/2046	GBP 34	38,622	0.1
United Kingdom Gilt	1.25%	07/31/2051	33	40,341	0.1
United Kingdom Gilt	1.50%	07/31/2053	12	16,026	0.0
United Kingdom Gilt	1.75%	09/07/2037	167	227,643	0.6
				<u>322,632</u>	<u>0.8</u>
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
U.S. Treasury Bonds	1.13%	08/15/2040	USD 487	402,460	1.0
U.S. Treasury Bonds	1.88%	02/15/2051	280	259,612	0.6
U.S. Treasury Bonds	2.00%	08/15/2051	140	133,853	0.3
U.S. Treasury Notes	0.13%	03/31/2023	80	79,125	0.2
U.S. Treasury Notes	0.13%	08/15/2023	782	768,804	1.9
U.S. Treasury Notes	0.25%	03/15/2024	159	155,075	0.4
U.S. Treasury Notes	0.25%	05/31/2025	347	331,439	0.8
U.S. Treasury Notes	0.38%	04/15/2024	115	112,323	0.3
U.S. Treasury Notes	0.50%	11/30/2023	460	452,956	1.1
U.S. Treasury Notes	0.75%	04/30/2026	67	64,372	0.2
U.S. Treasury Notes	1.25%	08/15/2031	50	47,469	0.1
U.S. Treasury Notes	1.38%	11/15/2031	449	430,338	1.0
U.S. Treasury Notes	1.63%	10/31/2026	90	89,550	0.2
U.S. Treasury Notes	2.13%	05/31/2026	180	182,841	0.4
				<u>3,510,217</u>	<u>8.5</u>
				<u>8,098,733</u>	<u>19.7</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
ABN AMRO Bank NV	0.60%	01/15/2027	EUR 100	108,992	0.3
Banco de Credito del Peru	3.13%	07/01/2030	USD 40	37,820	0.1
Banco Santander SA	1.13%	06/23/2027	EUR 100	110,169	0.3
Bank of America Corp.	2.69%	04/22/2032	USD 61	58,653	0.1
Bank of Nova Scotia (The)	0.25%	11/01/2028	EUR 100	103,215	0.2
Citigroup, Inc.	3.98%	03/20/2030	USD 45	47,379	0.1
Citigroup, Inc.	4.08%	04/23/2029	27	28,449	0.1
Credit Suisse AG/London	0.25%	01/05/2026	EUR 100	107,999	0.3
Danske Bank A/S	0.75%	06/09/2029	100	105,498	0.2
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	2.60%	02/07/2030	USD 28	26,924	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	3.38%	03/27/2025	EUR 45	54,184	0.1



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
HSBC Holdings PLC, Series GEN	0.31%	11/13/2026	EUR 100	\$ 108,635	0.3%
JPMorgan Chase & Co.	1.09%	03/11/2027	100	111,672	0.3
Morgan Stanley	0.41%	10/29/2027	100	107,654	0.2
Santander Holdings USA, Inc.	2.49%	01/06/2028	USD 12	11,656	0.0
Toronto-Dominion Bank (The)	0.50%	01/18/2027	EUR 100	108,768	0.3
US Bancorp, Series J(a)	5.30%	04/15/2027	USD 27	27,385	0.1
				<u>1,265,052</u>	<u>3.1</u>
<b>MAKLER</b>					
Charles Schwab Corp. (The), Series I(a)	4.00%	06/01/2026	38	36,628	0.1
SURA Asset Management SA	4.88%	04/17/2024	100	102,644	0.2
				<u>139,272</u>	<u>0.3</u>
<b>FINANZEN</b>					
Air Lease Corp.	2.10%	09/01/2028	3	2,763	0.0
Air Lease Corp.	3.25%	03/01/2025	2	2,018	0.0
Air Lease Corp.	3.63%	04/01/2027	9	9,178	0.0
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	9	8,570	0.0
Aviation Capital Group LLC	1.95%	09/20/2026	14	13,170	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	13	13,350	0.1
Synchrony Financial	2.88%	10/28/2031	27	25,088	0.1
				<u>74,137</u>	<u>0.2</u>
<b>REITS</b>					
Essential Properties LP	2.95%	07/15/2031	38	35,002	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	3.25%	01/15/2032	15	14,106	0.0
Host Hotels & Resorts LP, Series I	3.50%	09/15/2030	10	9,784	0.0
Host Hotels & Resorts LP, Series J	2.90%	12/15/2031	29	26,801	0.1
Office Properties Income Trust	3.45%	10/15/2031	16	14,663	0.0
Vornado Realty LP	3.40%	06/01/2031	40	38,697	0.1
				<u>139,053</u>	<u>0.3</u>
				<u>1,617,514</u>	<u>3.9</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Suzano Austria GmbH	3.75%	01/15/2031	12	11,229	0.0
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Charter Communications Operating LLC/ Charter Communications Operating Capital	5.38%	05/01/2047	20	21,033	0.1
Discovery Communications LLC	4.65%	05/15/2050	9	9,201	0.0
Discovery Communications LLC	5.20%	09/20/2047	16	17,372	0.0
Discovery Communications LLC	5.30%	05/15/2049	9	9,955	0.0
ViacomCBS, Inc.	5.50%	05/15/2033	25	29,119	0.1
				<u>86,680</u>	<u>0.2</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
AT&T, Inc.	4.30%	12/15/2042	23	23,892	0.1
AT&T, Inc.	5.15%	03/15/2042	8	9,252	0.0
British Telecommunications PLC	9.63%	12/15/2030	19	26,507	0.1
Corning, Inc.	5.45%	11/15/2079	20	23,153	0.0
				<u>82,804</u>	<u>0.2</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	43	43,519	0.1
Volkswagen Bank GmbH	1.25%	12/15/2025	EUR 17	19,207	0.1
Volkswagen Financial Services AG	0.88%	01/31/2028	35	38,005	0.1
				<u>100,731</u>	<u>0.3</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Las Vegas Sands Corp.	3.90%	08/08/2029	USD 30	28,712	0.1
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	26	28,098	0.0
				<u>56,810</u>	<u>0.1</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
CK Hutchison Finance 16 II Ltd.	0.88%	10/03/2024	EUR 100	113,197	0.3
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Altria Group, Inc.	3.13%	06/15/2031	100	113,954	0.2
Amgen, Inc.	3.00%	02/22/2029	USD 21	21,266	0.1
BAT Capital Corp.	4.91%	04/02/2030	40	42,732	0.1
Sutter Health, Series 20A	2.29%	08/15/2030	27	25,376	0.1
				<u>203,328</u>	<u>0.5</u>
<b>ENERGIE</b>					
Continental Resources, Inc./OK	2.88%	04/01/2032	23	21,052	0.1
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	15	16,729	0.1
Devon Energy Corp.	5.60%	07/15/2041	33	38,577	0.1
Enbridge Energy Partners LP	7.38%	10/15/2045	26	36,916	0.1
Energy Transfer LP	6.25%	04/15/2049	45	52,537	0.1
Exxon Mobil Corp.	0.84%	06/26/2032	EUR 100	103,513	0.3

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp. ....	3.55%	12/15/2029	USD 4	\$ 3,958	0.0%
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp. ....	3.80%	09/15/2030	8	8,015	0.0
Suncor Energy, Inc. ....	6.50%	06/15/2038	9	11,379	0.0
Suncor Energy, Inc. ....	6.85%	06/01/2039	18	23,705	0.1
TransCanada PipeLines Ltd. ....	6.20%	10/15/2037	11	13,896	0.0
TransCanada PipeLines Ltd. ....	7.63%	01/15/2039	11	15,702	0.0
Valero Energy Corp. ....	6.63%	06/15/2037	9	11,568	0.0
				<u>357,547</u>	<u>0.9</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Broadcom, Inc. ....	4.11%	09/15/2028	8	8,408	0.0
Dell International LLC/EMC Corp. ....	8.35%	07/15/2046	6	9,130	0.0
Fidelity National Information Services, Inc. ....	0.63%	12/03/2025	EUR 100	111,019	0.2
Kyndryl Holdings, Inc. ....	2.05%	10/15/2026	USD 23	21,701	0.1
Oracle Corp. ....	3.95%	03/25/2051	29	26,597	0.1
Western Digital Corp. ....	2.85%	02/01/2029	6	5,715	0.0
Western Digital Corp. ....	3.10%	02/01/2032	25	23,220	0.1
				<u>205,790</u>	<u>0.5</u>
<b>TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN</b>					
Southwest Airlines Co. Pass-Through Trust, Series 44743 ....	6.15%	08/01/2022	6	6,051	0.0
				<u>1,224,167</u>	<u>3.0</u>
<b>VERSORGBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
Enel Finance International NV ....	0.88%	01/17/2031	EUR 100	104,511	0.3
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. ....	1.90%	06/15/2028	USD 12	11,408	0.0
				<u>115,919</u>	<u>0.3</u>
				<u>2,957,600</u>	<u>7.2</u>
<b>GEDECKTE ANLEIHEN</b>					
Canadian Imperial Bank of Commerce ....	0.01%	10/07/2026	EUR 100	109,568	0.2
DNB Boligkreditt AS. ....	0.63%	06/19/2025	100	113,199	0.3
National Australia Bank Ltd. ....	2.25%	06/06/2025	100	118,924	0.3
National Bank of Canada ....	0.01%	09/29/2026	100	109,632	0.2
National Westminster Bank PLC ....	0.50%	05/15/2024	100	112,949	0.3
Royal Bank of Canada ....	0.25%	01/29/2024	100	112,639	0.3
Stadshypotek AB ....	0.50%	07/11/2025	100	112,799	0.3
Westpac Banking Corp. ....	0.50%	01/16/2025	100	112,720	0.3
				<u>902,430</u>	<u>2.2</u>
<b>INVESTMENTGESELLSCHAFTEN</b>					
<b>FONDS UND INVESTMENTTRUSTS</b>					
AB SICAV I - Low Volatility Equity Portfolio - Class S1 ....			20,423	820,202	2.0
<b>HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSAHLUNGEN</b>					
<b>FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT</b>					
Federal National Mortgage Association, Series 2012 ....	3.50%	02/01/2042	USD 5	5,580	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2012 ....	3.50%	11/01/2042	57	60,214	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2012 ....	3.50%	01/01/2043	9	9,957	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2013 ....	3.50%	04/01/2043	34	35,158	0.1
Uniform Mortgage-Backed Security Series 2022, TBA ....	2.50%	03/01/2052	234	230,782	0.6
Uniform Mortgage-Backed Security Series 2022, TBA ....	3.00%	03/01/2052	225	226,887	0.6
Uniform Mortgage-Backed Security Series 2022, TBA ....	3.50%	03/01/2052	147	151,213	0.4
				<u>719,791</u>	<u>1.8</u>
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
<b>Connecticut Avenue Securities Trust</b>					
Series 2021-R01, Class 1M1(b) ....	0.80%	10/25/2041	7	7,042	0.0
Series 2021-R01, Class 1M2(b) ....	1.60%	10/25/2041	10	10,052	0.0
Series 2021-R03, Class 1M1(b) ....	0.90%	12/25/2041	28	28,017	0.1
Series 2022-R01, Class 1M2(b) ....	1.95%	12/25/2041	100	97,273	0.2
Series 2022-R02, Class 2M1(b) ....	1.25%	01/25/2042	100	99,912	0.3
Eagle RE Ltd. Series 2018-1, Class M1(b) ....	1.88%	11/25/2028	52	51,517	0.1
<b>Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes</b>					
Series 2021-DNA3, Class M2(b) ....	2.15%	10/25/2033	17	16,947	0.0
Series 2021-DNA5, Class M2(b) ....	1.70%	01/25/2034	13	13,048	0.0
Series 2021-HQA4, Class M1(b) ....	1.00%	12/25/2041	31	31,084	0.1
<b>Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities</b>					
Series 2014-C03, Class 2M2(b) ....	3.09%	07/25/2024	5	4,793	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(b) ....	5.09%	11/25/2024	21	22,097	0.1
Series 2014-C04, Class 2M2(b) ....	5.19%	11/25/2024	4	4,504	0.0
Series 2015-C03, Class 2M2(b) ....	5.19%	07/25/2025	0*	157	0.0
Series 2015-C04, Class 1M2(b) ....	5.89%	04/25/2028	8	8,628	0.0
Series 2016-C01, Class 1M2(b) ....	6.94%	08/25/2028	14	14,199	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %	
Series 2016-C02, Class 1M2(b) .....	6.19%	09/25/2028	USD	31 \$	32,180	0.1%
Series 2016-C03, Class 1M2(b) .....	5.49%	10/25/2028		19	19,906	0.1
Series 2016-C05, Class 2M2(b) .....	4.64%	01/25/2029		42	43,202	0.1
Series 2016-C06, Class 1M2(b) .....	4.44%	04/25/2029		76	78,083	0.2
Series 2017-C01, Class 1M2(b) .....	3.74%	07/25/2029		47	47,808	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust						
Series 2019-1R, Class A(b) .....	2.10%	03/27/2024		29	29,384	0.1
					<u>659,833</u>	<u>1.6</u>
<b>REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN</b>						
<b>FRANKREICH</b>						
Dexia Credit Local SA .....	0.50%	01/17/2025	EUR	100	112,916	0.3
<b>DEUTSCHLAND</b>						
Landwirtschaftliche Rentenbank .....	0.63%	05/18/2027		33	37,463	0.1
<b>INDONESIEN</b>						
Indonesia Government International Bond .....	1.00%	07/28/2029		100	102,314	0.3
<b>MEXIKO</b>						
Mexico Government International Bond .....	3.38%	02/23/2031		110	127,562	0.3
<b>PANAMA</b>						
Panama Government International Bond .....	6.70%	01/26/2036	USD	45	55,302	0.1
<b>PERU</b>						
Peruvian Government International Bond .....	3.75%	03/01/2030	EUR	100	123,898	0.3
					<u>559,455</u>	<u>1.4</u>
<b>REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN</b>						
<b>KANADA</b>						
Export Development Canada .....	0.50%	02/25/2027		100	112,800	0.3
<b>JAPAN</b>						
Development Bank of Japan, Inc. ....	2.30%	03/19/2026	JPY	30,000	283,578	0.7
Development Bank of Japan, Inc., Series G .....	0.01%	10/15/2024	EUR	100	111,229	0.2
					<u>394,807</u>	<u>0.9</u>
					<u>507,607</u>	<u>1.2</u>
<b>INFLATIONSGEKÜPPELTE WERTPAPIERE</b>						
<b>AUSTRALIEN</b>						
Australia Government Bond, Series 30CI .....	2.50%	09/20/2030	AUD	130	147,171	0.4
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>						
U.S. Treasury Inflation Index .....	0.13%	10/15/2026	USD	143	153,517	0.4
U.S. Treasury Inflation Index .....	0.13%	01/15/2031		62	67,352	0.1
					<u>220,869</u>	<u>0.5</u>
					<u>368,040</u>	<u>0.9</u>
<b>GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN</b>						
<b>KANADA</b>						
Province of British Columbia Canada .....	4.25%	11/27/2024	AUD	130	100,353	0.2
Province of Ontario Canada, Series HC .....	2.70%	06/02/2029	CAD	95	76,735	0.2
					<u>177,088</u>	<u>0.4</u>
<b>QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE</b>						
<b>QUASI-STAATSANLEIHEN</b>						
<b>CHINA</b>						
State Grid Overseas Investment BVI Ltd. ....	1.25%	05/19/2022	EUR	100	112,461	0.3
<b>GEMEINDEVERWALTUNG – REGIONALANLEIHEN</b>						
<b>JAPAN</b>						
Japan Finance Organization for Municipalities, Series G .....	0.01%	02/02/2028		100	107,606	0.3
<b>SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN</b>						
European Stability Mechanism .....	0.00%	12/15/2026		21	23,402	0.0
International Bank for Reconstruction & Development, Series G .....	0.00%	01/15/2027		34	37,373	0.1
International Bank for Reconstruction & Development, Series GDIF .....	0.00%	02/21/2030		32	34,014	0.1
					<u>94,789</u>	<u>0.2</u>
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>						
<b>NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS</b>						
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-CBX, Class C .....	4.78%	06/15/2045	USD	55	53,457	0.1
<b>ABS-ANLEIHEN</b>						
<b>AUTOS – FESTVERZINSLICH</b>						
Flagship Credit Auto Trust, Series 2018-3, Class D .....	4.15%	12/16/2024		39	40,014	0.1

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series V(a) .....	4.13%	11/10/2026	USD 12	\$ 11,421	0.0%
				<u>38,004,298</u>	<u>92.5</u>
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>STAMMAKTIE</b>					
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>					
<b>KFZ-BESTANDTEILE</b>					
Faurecia SE(c) .....			1,760	<u>66,271</u>	<u>0.2</u>
<b>Gesamtanlagen</b>				<u>\$ 38,070,569</u>	<u>92.7%</u>
(Kosten \$35,600,034) .....					
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(d) .....	(0.21)%	–		1,242	0.0
BBH, Grand Cayman(d) .....	0.25 %	–		3,149	0.0
BBH, Grand Cayman(d) .....	3.00 %	–		567	0.0
BNP Paribas, Paris(d) .....	(0.78)%	–		589	0.0
BNP Paribas, Paris(d) .....	(0.74)%	–		1,757	0.0
BNP Paribas, Paris(d) .....	(0.31)%	–		1,017	0.0
BNP Paribas, Paris(d) .....	0.00 %	–		5,174	0.0
BNP Paribas, Paris(d) .....	0.07 %	–		22	0.0
BNP Paribas, Paris(d) .....	0.08 %	–		766	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(d) .....	(1.54)%	–		6,834	0.0
HSBC Bank PLC, London(d) .....	0.10 %	–		594	0.0
JPMorgan Chase, New York(d) .....	0.01 %	–		2,934,993	7.2
Nordea Bank Abp, Oslo(d) .....	0.07 %	–		712	0.0
Royal Bank of Canada, Toronto(d) .....	0.01 %	–		29,101	0.1
SEB, Stockholm(d) .....	(0.31)%	–		8,250	0.0
SEB, Stockholm(d) .....	0.10 %	–		3,366	0.0
Sumitomo, London(d) .....	(0.31)%	–		16,172	0.0
Sumitomo, Tokyo(d) .....	(0.78)%	–		<u>202,205</u>	<u>0.5</u>
<b>Termineinlagen insgesamt</b> .....				<u>3,216,510</u>	<u>7.8</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> .....				<u>(218,080)</u>	<u>(0.5)</u>
<b>Nettovermögen</b> .....				<u>\$ 41,068,999</u>	<u>100.0%</u>

**TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
<b>Long</b>					
10 Yr Australian Bond Futures .....	03/15/2022	1	\$ 100,868	\$ 97,709	\$ (3,159)
10 Yr Mini Japan Government Bond Futures .....	03/11/2022	7	924,986	916,670	(8,316)
Euro-Bund Futures .....	03/08/2022	4	770,198	749,174	(21,024)
Korea 3 Yr Bond Futures .....	03/15/2022	2	207,594	199,609	(7,985)
Long Gilt Futures .....	06/28/2022	1	163,958	165,112	1,154
MSCI Emerging Markets Index Futures .....	03/18/2022	8	497,885	470,200	(27,685)
OMXS30 Index Futures .....	03/18/2022	22	513,923	491,311	(22,612)
SPI 200 Futures .....	03/17/2022	2	261,301	255,855	(5,446)
TOPIX Index Futures .....	03/10/2022	2	322,185	329,490	7,305
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures .....	06/30/2022	2	429,352	430,453	1,101
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures .....	06/21/2022	9	1,137,501	1,146,938	9,437
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures .....	06/21/2022	1	183,211	185,938	2,727
<b>Short</b>					
10 Yr Canadian Bond Futures .....	06/21/2022	1	107,487	107,826	(339)
EURO STOXX 50 Index Futures .....	03/18/2022	9	404,808	393,849	10,959
Euro-BOBL Futures .....	03/08/2022	8	1,200,175	1,182,784	17,391
Euro-Schatz Futures .....	03/08/2022	4	503,172	502,275	897
FTSE 100 IDX Futures .....	03/18/2022	6	600,118	596,789	3,329
Hang Seng Index Futures .....	03/30/2022	1	147,122	145,078	2,044
MSCI Singapore IX ETS Futures .....	03/30/2022	2	50,754	49,233	1,521
S&P 500 E-Mini Futures .....	03/18/2022	7	1,523,768	1,528,800	(5,032)
S&P/TSX 60 IX Futures .....	03/17/2022	3	618,382	603,740	14,642
					<u>\$ (29,091)</u>
				Wertsteigerung	\$ 72,507
				Wertminderung	\$ (101,598)

**DEWISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	RUB	2,041	USD	27	03/02/2022	\$ 8,286
Bank of America, NA	USD	26	INR	1,970	04/07/2022	(192)
Bank of America, NA	KRW	199,143	USD	167	04/28/2022	1,858
Bank of America, NA	USD	5	TWD	144	04/28/2022	(102)
Barclays Bank PLC	INR	1,970	USD	26	04/07/2022	92
Barclays Bank PLC	KRW	8,534	USD	7	04/28/2022	24
Barclays Bank PLC	TWD	983	USD	35	04/29/2022	300
BNP Paribas SA	USD	8	TWD	209	04/28/2022	(53)
BNP Paribas SA	USD	6	TWD	159	04/28/2022	20
BNP Paribas SA	CNH	2,294	USD	359	05/18/2022	(2,591)
Brown Brothers Harriman & Co.	ILS	209	USD	67	03/03/2022	1,760
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	16	ILS	51	03/03/2022	(17)
Brown Brothers Harriman & Co.	THB	1,102	USD	33	03/10/2022	(1,025)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	679	USD	926	03/17/2022	16,625
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	557	GBP	409	03/17/2022	(8,962)
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN	1,130	USD	55	03/24/2022	(158)
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN	279	USD	14	03/24/2022	8
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK	749	USD	85	03/24/2022	85
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK	3,319	USD	360	03/24/2022	9,388
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	11	MXN	208	03/24/2022	(52)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	156	NOK	1,375	03/24/2022	134
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	73	SEK	674	03/24/2022	(2,254)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF	570	USD	617	04/13/2022	(5,260)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF	75	USD	82	04/13/2022	215
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	274	CHF	251	04/13/2022	325
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	18	SGD	24	04/21/2022	(111)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	26	ZAR	401	04/21/2022	(248)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	358	USD	282	04/22/2022	(939)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	228	CAD	288	04/22/2022	(298)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	298	CAD	379	04/22/2022	954
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	572	USD	407	04/28/2022	(8,807)
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY	45,048	USD	390	04/28/2022	(1,834)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	49	AUD	69	04/28/2022	1,332
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	646	JPY	74,502	04/28/2022	1,867
Brown Brothers Harriman & Co.	PLN	99	USD	23	05/06/2022	(220)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	25	PLN	99	05/06/2022	(1,446)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	1,074	USD	1,227	05/12/2022	19,284
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	356	EUR	312	05/12/2022	(5,139)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	41	EUR	37	05/12/2022	384
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	46	USD	52	03/18/2022	438
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	3,434	EUR	3,023	03/18/2022	(44,295)
Citibank, NA	BRL	155	USD	30	03/03/2022	80
Citibank, NA	USD	28	BRL	155	03/03/2022	1,815
Citibank, NA	AUD	1,438	USD	1,015	04/28/2022	(29,828)
Citibank, NA	USD	19	CNH	124	05/18/2022	67
Goldman Sachs Bank USA	BRL	101	USD	20	04/04/2022	247
Goldman Sachs Bank USA	MYR	278	USD	66	06/16/2022	(560)
HSBC Bank USA	TWD	792	USD	29	04/29/2022	235
HSBC Bank USA	USD	12	CNH	74	05/18/2022	43
JPMorgan Chase Bank, NA	BRL	155	USD	30	03/03/2022	(180)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	30	BRL	155	03/03/2022	(80)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	511	SEK	4,656	03/24/2022	(19,024)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	27	RUB	2,041	03/02/2022	(8,331)
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL	81	USD	16	03/03/2022	42
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	16	BRL	81	03/03/2022	(465)
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL	81	USD	16	04/04/2022	465
Morgan Stanley Capital Services LLC	TWD	1,446	USD	53	04/28/2022	957
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	5	KRW	5,987	04/28/2022	(14)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	7	KRW	8,559	04/28/2022	38
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	4,125	USD	4,723	05/12/2022	84,138
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	11	CNH	72	05/18/2022	(7)
Royal Bank of Scotland PLC	BRL	81	USD	16	03/03/2022	249
Royal Bank of Scotland PLC	USD	16	BRL	81	03/03/2022	(42)
Standard Chartered Bank	BRL	121	USD	24	04/04/2022	232
Standard Chartered Bank	IDR	662,329	USD	46	04/28/2022	(38)
Standard Chartered Bank	JPY	287,656	USD	2,504	04/28/2022	(1,639)
						\$ 7,776
						\$ 151,987
						\$ (144,211)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	EUR 100	09/30/2050	6 Month EURIBOR	(0.017)%	\$ (7,032)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	100	11/10/2050	6 Month EURIBOR	(0.043)%	(6,995)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	NZD 270	11/02/2024	3 Month BKBM	2.503%	(2,128)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	100	11/01/2024	3 Month BKBM	2.580%	(791)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	EUR 100	11/10/2050	0.022%	6 Month EURIBOR	7,113
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	100	09/30/2050	0.122%	6 Month EURIBOR	7,283
					<u>\$ (2,550)</u>
				Wertsteigerung	\$ 14,396
				Wertminderung	\$ (16,946)

TOTAL-RETURN-SWAPS

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahler/ Erhaltener Zinssatz	Nominal- betrag (000)	Fälligkeits- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Gesamtrendite auf Referenz-Obligation erhalten</b>					
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Bloomberg Commodity Index	4,609	0 12%	USD 1,201	03/15/2022	\$ 213,614
JPMorgan Chase Bank, NA					
FTSE EPRA/NAREIT Developed Real Estate Index	52	OBFR Plus 0.50%	341	04/18/2022	(14,627)
UBS AG					
FTSE EPRA/NAREIT Developed Real Estate Index	181	OBFR Plus 0.43%	1,191	09/15/2022	(54,913)
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Swiss Market Index Futures	10	0.00%	122	03/18/2022	(4,043)
Insgesamt					<u>\$ 140,031</u>
				Wertsteigerung	\$ 213,614
				Wertminderung	\$ (73,583)
Swaps insgesamt					<u>\$ 137,481</u>

\* Kapitalbetrag geringer als 500.

- (a) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (b) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2022.
- (c) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (d) 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
- IDR – Indonesian Rupiah
- ILS – Israeli Shekel
- INR – Indian Rupee
- JPY – Japanese Yen
- KRW – South Korean Won
- MXN – Mexican Peso
- MYR – Malaysian Ringgit
- NOK – Norwegian Krone
- NZD – New Zealand Dollar
- PLN – Polish Zloty
- RUB – Russian Ruble
- SEK – Swedish Krona

SGD – Singapore Dollar  
THB – Thailand Baht  
TWD – New Taiwan Dollar  
USD – United States Dollar  
ZAR – South African Rand

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt  
BKBM – Bank Bill Benchmark (New Zealand)  
BOBL – Bundesobligationen  
CBT – Chicago Board of Trade  
CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities  
EPRA – European Public Real Estate Association  
ETS – Emission Trading Scheme  
EURIBOR – Euro Interbank Offered Rate  
FTSE – Financial Times Stock Exchange  
GDR – Global Depositary Receipt  
LCH – London Clearing House  
MSCI – Morgan Stanley Capital International  
NAREIT – National Association of Real Estate Investment Trusts  
OBFR – Overnight Bank Funding Rate  
OMXS – Stockholm Stock Exchange  
REG – Registered Shares  
REIT – Real Investment Trust  
SPI – Share Price Index  
TBA – To Be Announced  
TOPIX – Tokyo Price Index  
TSX – Toronto Stock Exchange

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIEN</b>			
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG</b>			
Calix, Inc. ....	20,328	\$ 1,104,645	0.9%
Lumentum Holdings, Inc. ....	15,796	1,561,580	1.3
		<u>2,666,225</u>	<u>2.2</u>
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
Flex Ltd. ....	75,706	1,248,397	1.0
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Block, Inc. - Class A ....	6,503	829,071	0.7
Network International Holdings PLC ....	10,043	30,234	0.0
Nihon Unisys Ltd. ....	21,367	585,376	0.5
Visa, Inc. - Class A ....	7,426	1,604,997	1.4
		<u>3,049,678</u>	<u>2.6</u>
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>			
ASML Holding NV ....	1,319	882,233	0.7
Infineon Technologies AG ....	26,548	898,261	0.7
MediaTek, Inc. ....	24,142	954,004	0.8
Novatek Microelectronics Corp. ....	36,166	599,576	0.5
NXP Semiconductors NV ....	8,558	1,627,077	1.4
ON Semiconductor Corp. ....	10,590	663,039	0.6
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. ....	95,304	2,048,981	1.7
Wolfspeed, Inc. ....	5,736	589,184	0.5
		<u>8,262,355</u>	<u>6.9</u>
<b>SOFTWARE</b>			
ACI Worldwide, Inc. ....	18,570	622,468	0.5
Adobe, Inc. ....	2,153	1,007,018	0.9
CommVault Systems, Inc. ....	15,332	964,542	0.8
Dassault Systemes SE ....	23,089	1,113,747	0.9
Microsoft Corp. ....	4,176	1,247,867	1.1
NortonLifeLock, Inc. ....	28,293	819,920	0.7
Oracle Corp. ....	20,789	1,579,330	1.3
		<u>7,354,892</u>	<u>6.2</u>
<b>TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE</b>			
Apple, Inc. ....	7,646	1,262,469	1.1
Samsung Electronics Co., Ltd. ....	14,677	884,340	0.7
Western Digital Corp. ....	24,785	1,262,572	1.1
		<u>3,409,381</u>	<u>2.9</u>
		<u>25,990,928</u>	<u>21.8</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>			
<b>LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG</b>			
Airbus SE ....	7,586	968,572	0.8
Hexcel Corp. ....	15,715	909,906	0.8
		<u>1,878,478</u>	<u>1.6</u>
<b>BAUPRODUKTE</b>			
Owens Corning ....	8,147	759,207	0.6
Trex Co., Inc. ....	10,181	935,007	0.8
		<u>1,694,214</u>	<u>1.4</u>
<b>GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF</b>			
ADT, Inc. ....	109,774	802,449	0.7
MillerKnoll, Inc. ....	13,503	524,984	0.4
Tetra Tech, Inc. ....	7,079	1,123,961	1.0
TOMRA Systems ASA ....	17,342	816,152	0.7
Waste Management, Inc. ....	10,068	1,453,791	1.2
		<u>4,721,337</u>	<u>4.0</u>
<b>BAU- UND INGENIEURWESEN</b>			
AECOM ....	10,866	789,504	0.7
Dycom Industries, Inc. ....	6,702	583,518	0.5
		<u>1,373,022</u>	<u>1.2</u>
<b>ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG</b>			
Regal Rexnord Corp. ....	6,459	1,035,660	0.9
Rockwell Automation, Inc. ....	4,299	1,145,961	1.0
Schneider Electric SE (Paris) ....	3,390	525,284	0.4
Vestas Wind Systems A/S ....	53,650	1,730,025	1.4
		<u>4,436,930</u>	<u>3.7</u>



	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>MASCHINEN</b>			
Alstom SA	16,996	\$ 432,373	0.4%
Amada Co., Ltd.	65,133	577,132	0.5
Deere & Co.	3,714	1,337,134	1.1
Oshkosh Corp.	8,721	968,348	0.8
SMC Corp.	1,912	1,142,310	1.0
Xylem, Inc./NY	7,068	628,676	0.5
		<u>5,085,973</u>	<u>4.3</u>
<b>PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Recruit Holdings Co., Ltd.	16,640	702,373	0.6
Robert Half International, Inc.	9,158	1,101,603	0.9
		<u>1,803,976</u>	<u>1.5</u>
<b>STRASSE UND SCHIENE</b>			
XPO Logistics, Inc.	13,638	991,193	0.8
<b>HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER</b>			
Air Lease Corp.	21,278	888,552	0.7
		<u>22,873,675</u>	<u>19.2</u>
<b>FINANZWERTE</b>			
<b>BANKEN</b>			
Bank Leumi Le-Israel BM	70,858	767,595	0.7
Bank of Ireland Group PLC	180,967	1,200,763	1.0
Erste Group Bank AG	34,039	1,209,970	1.0
Grupo Financiero Banorte SAB de CV - Class O	161,067	1,093,046	0.9
HDFC Bank Ltd.	54,755	1,039,405	0.9
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A	199,924	700,410	0.6
KB Financial Group, Inc.	17,707	873,589	0.7
Nordea Bank Abp	85,869	950,017	0.8
SVB Financial Group	2,779	1,684,148	1.4
Wells Fargo & Co.	24,424	1,303,521	1.1
		<u>10,822,464</u>	<u>9.1</u>
<b>KAPITALMÄRKTE</b>			
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	155,777	438,261	0.4
Deutsche Boerse AG	4,095	697,047	0.6
London Stock Exchange Group PLC	5,922	517,362	0.4
MSCI, Inc. - Class A	2,577	1,292,645	1.1
Partners Group Holding AG	817	1,104,324	0.9
		<u>4,049,639</u>	<u>3.4</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>			
Aflac, Inc.	15,217	929,592	0.8
AIA Group Ltd.	64,105	665,654	0.5
Intact Financial Corp.	0 *	10	0.0
Suncorp Group Ltd.	135,307	1,052,518	0.9
		<u>2,647,774</u>	<u>2.2</u>
		<u>17,519,877</u>	<u>14.7</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
<b>BIOTECHNOLOGIE</b>			
Abcam PLC	39,935	667,971	0.6
<b>GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF</b>			
Alcon, Inc.	13,163	1,016,914	0.8
Becton Dickinson and Co.	5,533	1,501,110	1.3
Koninklijke Philips NV	24,918	851,159	0.7
Medtronic PLC	10,323	1,083,851	0.9
STERIS PLC	5,230	1,255,319	1.1
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	6,750	858,481	0.7
		<u>6,566,834</u>	<u>5.5</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Apollo Hospitals Enterprise Ltd.	11,815	756,236	0.6
Centene Corp.	10,002	826,346	0.7
		<u>1,582,582</u>	<u>1.3</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE</b>			
Change Healthcare, Inc.	40,775	873,405	0.7
<b>LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A	1,727	1,081,161	0.9
Bruker Corp.	12,353	869,264	0.7
Danaher Corp.	4,938	1,354,933	1.1
Gerresheimer AG(a)	7,973	573,250	0.5
West Pharmaceutical Services, Inc.	1,476	571,146	0.5
		<u>4,449,754</u>	<u>3.7</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>PHARMAZEUTIKA</b>			
Roche Holding AG (Genusschein) .....	5,175	\$ 1,960,127	1.7%
		<u>16,100,673</u>	<u>13.5</u>
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>KFZ-BESTANDTEILE</b>			
Aptiv PLC .....	6,429	832,173	0.7
Goodyear Tire & Rubber Co. (The) .....	43,107	667,724	0.5
		<u>1,499,897</u>	<u>1.2</u>
<b>KRAFTFAHRZEUGE</b>			
BYD Co., Ltd. ....	33,377	1,034,266	0.9
Stellantis NV .....	48,693	888,106	0.7
		<u>1,922,372</u>	<u>1.6</u>
<b>HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT</b>			
Entain PLC .....	40,865	918,755	0.8
Tongcheng Travel Holdings Ltd. ....	271,065	504,844	0.4
		<u>1,423,599</u>	<u>1.2</u>
<b>HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER</b>			
PulteGroup, Inc. ....	17,606	874,296	0.7
TopBuild Corp. ....	5,280	1,133,469	1.0
		<u>2,007,765</u>	<u>1.7</u>
<b>EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB</b>			
eBay, Inc. ....	12,890	703,638	0.6
<b>SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL</b>			
AutoZone, Inc. ....	385	717,808	0.6
Zhongsheng Group Holdings Ltd. ....	79,607	555,888	0.5
		<u>1,273,696</u>	<u>1.1</u>
<b>TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER</b>			
Carter's, Inc. ....	9,254	894,695	0.8
NIKE, Inc. - Class B .....	8,113	1,107,819	0.9
Tapestry, Inc. ....	23,477	960,226	0.8
		<u>2,962,740</u>	<u>2.5</u>
		<u>11,793,707</u>	<u>9.9</u>
<b>VERSORGUNG</b>			
<b>STROMVERSORGBETRIEBE</b>			
EDP - Energias de Portugal SA .....	237,588	1,160,013	1.0
Enel SpA .....	135,239	996,566	0.8
NextEra Energy, Inc. ....	14,467	1,132,306	1.0
		<u>3,288,885</u>	<u>2.8</u>
<b>GASVERSORGBETRIEBE</b>			
China Resources Gas Group Ltd. ....	118,475	544,154	0.5
Kunlun Energy Co., Ltd. ....	994,911	978,677	0.8
		<u>1,522,831</u>	<u>1.3</u>
<b>WASSERVERSORGER</b>			
American Water Works Co., Inc. ....	4,281	646,842	0.5
		<u>5,458,558</u>	<u>4.6</u>
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN</b>			
<b>DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Charter Communications, Inc. - Class A .....	2,381	1,433,003	1.2
Comcast Corp. - Class A .....	34,957	1,634,572	1.4
Deutsche Telekom AG (REG) .....	48,361	866,848	0.7
		<u>3,934,423</u>	<u>3.3</u>
<b>UNTERHALTUNG</b>			
Electronic Arts, Inc. ....	7,350	956,199	0.8
		<u>4,890,622</u>	<u>4.1</u>
<b>GRUNDSTOFFE</b>			
<b>CHEMIKALIEN</b>			
Chr Hansen Holding A/S .....	8,776	639,816	0.5
Koninklijke DSM NV .....	5,665	1,063,599	0.9
Tosoh Corp. ....	53,175	825,175	0.7
		<u>2,528,590</u>	<u>2.1</u>
<b>METALL UND BERGBAU</b>			
ArcelorMittal SA .....	30,640	950,715	0.8
Endeavour Mining PLC .....	27,208	720,091	0.6
		<u>1,670,806</u>	<u>1.4</u>
		<u>4,199,396</u>	<u>3.5</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>					
<b>GETRÄNKE</b>					
Coca-Cola Co. (The) .....			17,770	\$ 1,105,994	0.9%
<b>LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL</b>					
Atacadao SA .....			155,237	572,226	0.5
<b>LEBENSMITTELPRODUKTE</b>					
Hain Celestial Group, Inc. (The) .....			24,361	885,757	0.7
Nichirei Corp. ....			25,385	559,389	0.5
Nomad Foods Ltd. ....			24,331	612,654	0.5
Salmar ASA .....			2,897	212,887	0.2
				<u>2,270,687</u>	<u>1.9</u>
				<u>3,948,907</u>	<u>3.3</u>
<b>IMMOBILIEN</b>					
<b>AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)</b>					
Americold Realty Trust .....			29,342	784,006	0.7
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG</b>					
CIFI Holdings Group Co., Ltd. ....			1,340,850	934,186	0.8
				<u>1,718,192</u>	<u>1.5</u>
<b>ENERGIE</b>					
<b>ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE</b>					
Shell PLC .....			58,296	1,544,730	1.3
				<u>116,039,265</u>	<u>97.4</u>
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>STAMMAKTIE</b>					
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>					
<b>KFZ-BESTANDTEILE</b>					
Faurecia SE(b) .....			21,991	828,063	0.7
<b>Gesamtanlagen</b>					
(Kosten \$111,677,983) .....				\$ 116,867,328	98.1%
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(c) .....	(0.21)%	–		44	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(c) .....	0.00 %	–		963	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(c) .....	0.01 %	–		695,353	0.6
Barclays, London(c) .....	0.01 %	–		847	0.0
BNP Paribas, Paris(c) .....	(0.74)%	–		5,683	0.0
BNP Paribas, Paris(c) .....	(0.31)%	–		11,417	0.0
BNP Paribas, Paris(c) .....	0.00 %	–		11,686	0.0
BNP Paribas, Paris(c) .....	0.07 %	–		102,675	0.1
Credit Suisse AG, Zurich(c) .....	(1.54)%	–		5,864	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(c) .....	(0.78)%	–		23,554	0.0
JPMorgan Chase, New York(c) .....	0.01 %	–		1,379,032	1.2
Sumitomo, London(c) .....	0.10 %	–		43,375	0.0
<b>Termineinlagen insgesamt</b> .....				<u>2,280,493</u>	<u>1.9</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> .....				<u>930</u>	<u>0.0</u>
<b>Nettovermögen</b> .....				<u>\$ 119,148,751</u>	<u>100.0%</u>

**DEVISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd. ....	USD 924	AUD 1,308	04/28/2022	\$ 27,222
Bank of America, NA. ....	USD 400	GBP 294	03/17/2022	(5,265)
Bank of America, NA. ....	USD 381	SEK 3,578	03/24/2022	(3,335)
Bank of America, NA. ....	INR 86,035	USD 1,143	04/07/2022	8,395
Bank of America, NA. ....	USD 144	CHF 132	04/13/2022	140
Bank of America, NA. ....	JPY 18,669	USD 162	04/28/2022	(100)
Bank of America, NA. ....	KRW 1,912,164	USD 1,607	04/28/2022	17,839
Bank of America, NA. ....	USD 132	JPY 15,224	04/28/2022	815
Bank of America, NA. ....	USD 924	KRW 1,099,819	04/28/2022	(10,261)
Barclays Bank PLC .....	USD 181	RUB 13,524	03/02/2022	(55,735)
Barclays Bank PLC .....	USD 874	GBP 639	03/17/2022	(16,993)
Barclays Bank PLC .....	HKD 1,439	USD 185	04/28/2022	459
Barclays Bank PLC .....	TWD 12,359	USD 451	04/28/2022	9,328
Barclays Bank PLC .....	CNH 2,092	USD 328	05/18/2022	(1,308)
BNP Paribas SA .....	CNH 29,180	USD 4,562	05/18/2022	(32,966)

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
BNP Paribas SA	USD	1,499	CNH	9,587	05/18/2022	\$ 10,831
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF	122	USD	133	04/13/2022	(482)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	92	CHF	84	04/13/2022	(31)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	123	USD	140	05/12/2022	1,138
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	78	EUR	69	05/12/2022	(621)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	326	USD	368	03/18/2022	1,777
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	5,913	EUR	5,202	03/18/2022	(76,346)
Citibank, NA	RUB	13,524	USD	153	03/02/2022	28,265
Citibank, NA	BRL	1,342	USD	261	03/03/2022	688
Citibank, NA	USD	245	BRL	1,342	03/03/2022	15,713
Citibank, NA	GBP	125	USD	169	03/17/2022	757
Citibank, NA	INR	20,490	USD	271	04/07/2022	1,034
Citibank, NA	USD	498	INR	37,540	04/07/2022	(2,737)
Citibank, NA	EUR	194	USD	221	05/12/2022	2,641
Citibank, NA	USD	421	EUR	370	05/12/2022	(4,787)
Citibank, NA	CNH	1,196	USD	188	05/18/2022	(642)
Citibank, NA	USD	136	CNH	869	05/18/2022	466
Deutsche Bank AG	ILS	1,072	USD	342	03/03/2022	8,134
Deutsche Bank AG	USD	45	ILS	144	03/03/2022	(47)
Deutsche Bank AG	NOK	6,990	USD	794	03/24/2022	876
Deutsche Bank AG	USD	88	ZAR	1,346	04/21/2022	(1,283)
Goldman Sachs Bank USA	GBP	103	USD	138	03/17/2022	494
Goldman Sachs Bank USA	USD	90	NOK	815	03/24/2022	2,012
Goldman Sachs Bank USA	CAD	116	USD	91	04/22/2022	(424)
HSBC Bank USA	ILS	946	USD	304	03/03/2022	9,124
HSBC Bank USA	USD	160	ILS	513	03/03/2022	(234)
JPMorgan Chase Bank, NA	NOK	2,341	USD	264	03/24/2022	(1,895)
JPMorgan Chase Bank, NA	SEK	3,393	USD	371	03/24/2022	12,142
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	143	NOK	1,266	03/24/2022	315
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	323	SEK	3,012	03/24/2022	(4,664)
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL	1,342	USD	268	03/03/2022	7,699
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	261	BRL	1,342	03/03/2022	(688)
Morgan Stanley Capital Services LLC	GBP	212	USD	286	03/17/2022	1,277
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	215	GBP	157	03/17/2022	(5,048)
Morgan Stanley Capital Services LLC	MXN	18,566	USD	900	03/24/2022	(2,589)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	266	BRL	1,342	04/04/2022	(7,704)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	121	ZAR	1,861	04/21/2022	(1,057)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	1,774	CAD	2,256	04/22/2022	5,832
Morgan Stanley Capital Services LLC	KRW	112,915	USD	95	04/28/2022	1,018
Morgan Stanley Capital Services LLC	TWD	7,778	USD	280	04/29/2022	1,769
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	217	USD	247	05/12/2022	2,868
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	560	EUR	501	05/12/2022	3,576
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	280	EUR	246	05/12/2022	(3,198)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	327	CNH	2,076	05/18/2022	(188)
Standard Chartered Bank	USD	184	HKD	1,439	04/28/2022	(305)
Standard Chartered Bank	USD	1,339	JPY	153,877	04/28/2022	877
Standard Chartered Bank	TWD	26,730	USD	962	04/29/2022	6,081
State Street Bank & Trust Co.	USD	99	NOK	879	03/24/2022	695
UBS AG	CHF	646	USD	700	04/13/2022	(6,179)
UBS AG	EUR	7,120	USD	8,147	05/12/2022	141,820
						\$ 87,005
					Wertsteigerung	\$ 334,117
					Wertminderung	\$ (247,112)

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

(c) 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  
ILS – Israeli Shekel  
INR – Indian Rupee  
JPY – Japanese Yen  
KRW – South Korean Won  
MXN – Mexican Peso  
NOK – Norwegian Krone  
RUB – Russian Ruble  
SEK – Swedish Krona  
TWD – New Taiwan Dollar  
USD – United States Dollar  
ZAR – South African Rand

Glossar:

REG – Registered Shares  
REIT – Real Estate Investment Trust

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Nihon Unisys Ltd. ....	287,033	\$ 7,863,617	0.9%
Visa, Inc. - Class A .....	61,064	13,197,219	1.6
		<u>21,060,836</u>	<u>2.5</u>
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>			
Novatek Microelectronics Corp. ....	485,834	8,054,382	0.9
NXP Semiconductors NV .....	43,632	8,295,314	1.0
ON Semiconductor Corp. ....	142,260	8,906,900	1.1
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. ....	771,564	16,588,285	2.0
		<u>41,844,881</u>	<u>5.0</u>
<b>SOFTWARE</b>			
ACI Worldwide, Inc. ....	249,460	8,361,897	1.0
CommVault Systems, Inc. ....	205,963	12,957,127	1.6
NortonLifeLock, Inc. ....	380,067	11,014,353	1.3
Oracle Corp. ....	279,266	21,215,849	2.6
		<u>53,549,226</u>	<u>6.5</u>
<b>TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE</b>			
Samsung Electronics Co., Ltd. ....	197,163	11,879,740	1.4
Western Digital Corp. ....	332,955	16,960,704	2.1
		<u>28,840,444</u>	<u>3.5</u>
		<u>145,295,387</u>	<u>17.5</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>			
<b>LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG</b>			
Airbus SE .....	101,906	13,011,270	1.6
<b>GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF</b>			
ADT, Inc. ....	1,474,646	10,779,661	1.3
MillerKnoll, Inc. ....	181,387	7,052,340	0.8
		<u>17,832,001</u>	<u>2.1</u>
<b>BAU- UND INGENIEURWESEN</b>			
AECOM .....	145,964	10,605,764	1.3
Dycom Industries, Inc. ....	90,038	7,838,666	0.9
		<u>18,444,430</u>	<u>2.2</u>
<b>ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG</b>			
Regal Rexnord Corp. ....	86,763	13,912,488	1.7
<b>MASCHINEN</b>			
Alstom SA .....	228,313	5,808,269	0.7
Amada Co., Ltd. ....	874,967	7,752,878	0.9
Oshkosh Corp. ....	117,149	13,008,257	1.6
		<u>26,569,404</u>	<u>3.2</u>
<b>PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Robert Half International, Inc. ....	123,022	14,798,329	1.8
<b>STRASSE UND SCHIENE</b>			
XPO Logistics, Inc. ....	183,202	13,315,139	1.6
<b>HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER</b>			
Air Lease Corp. ....	285,831	11,936,320	1.4
		<u>129,819,381</u>	<u>15.6</u>
<b>FINANZWERTE</b>			
<b>BANKEN</b>			
Bank Leumi Le-Israel BM .....	951,862	10,311,450	1.3
Bank of Ireland Group PLC .....	2,431,015	16,130,399	2.0
Grupo Financiero Banorte SAB de CV - Class O .....	2,163,683	14,683,381	1.8
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A .....	2,685,676	9,408,926	1.1
KB Financial Group, Inc. ....	237,873	11,735,314	1.4
Nordea Bank Abp .....	1,153,521	12,762,013	1.5
Wells Fargo & Co. ....	328,102	17,510,791	2.1
		<u>92,542,274</u>	<u>11.2</u>
<b>KAPITALMÄRKTE</b>			
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao .....	2,092,623	5,887,358	0.7
<b>VERSICHERUNGEN</b>			
Intact Financial Corp. ....	1	133	0.0
Suncorp Group Ltd. ....	1,817,643	14,138,958	1.7
		<u>14,139,091</u>	<u>1.7</u>
		<u>112,568,723</u>	<u>13.6</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>KFZ-BESTANDTEILE</b>			
Goodyear Tire & Rubber Co. (The) .....	579,073	\$ 8,969,844	1.1%
<b>KRAFTFAHRZEUGE</b>			
Stellantis NV .....	654,119	11,930,328	1.4
<b>HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT</b>			
Entain PLC .....	548,965	12,342,051	1.5
Tongcheng-ELong Holdings Ltd. ....	3,641,335	6,781,804	0.8
		<u>19,123,855</u>	<u>2.3</u>
<b>HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER</b>			
PulteGroup, Inc. ....	236,504	11,744,807	1.4
<b>EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB</b>			
eBay, Inc. ....	173,151	9,452,286	1.1
<b>SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL</b>			
AutoZone, Inc. ....	5,175	9,642,640	1.2
Zhongsheng Group Holdings Ltd. ....	1,069,393	7,467,497	0.9
		<u>17,110,137</u>	<u>2.1</u>
<b>TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER</b>			
Carter's, Inc. ....	124,316	12,018,852	1.4
Tapestry, Inc. ....	315,383	12,899,148	1.6
		<u>24,918,000</u>	<u>3.0</u>
		<u>103,249,257</u>	<u>12.4</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
<b>GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF</b>			
Medtronic PLC .....	138,679	14,559,868	1.8
Zimmer Biomet Holdings, Inc. ....	90,670	11,532,369	1.4
		<u>26,092,237</u>	<u>3.2</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Centene Corp. ....	134,358	11,100,677	1.3
<b>GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE</b>			
Change Healthcare, Inc. ....	547,752	11,732,844	1.4
<b>PHARMAZEUTIKA</b>			
Roche Holding AG (Genusschein) .....	69,525	26,331,275	3.2
		<u>75,257,033</u>	<u>9.1</u>
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN</b>			
<b>DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Charter Communications, Inc. - Class A .....	31,989	19,250,176	2.3
Comcast Corp. - Class A .....	469,588	21,957,952	2.7
Deutsche Telekom AG (REG) .....	649,649	11,644,762	1.4
		<u>52,852,890</u>	<u>6.4</u>
<b>UNTERHALTUNG</b>			
Electronic Arts, Inc. ....	98,740	12,845,049	1.5
		<u>65,697,939</u>	<u>7.9</u>
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>			
<b>GETRÄNKE</b>			
Coca-Cola Co. (The) .....	238,710	14,857,321	1.8
<b>LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL</b>			
Atacadao SA .....	2,085,363	7,686,973	0.9
<b>LEBENSMITTELPRODUKTE</b>			
Hain Celestial Group, Inc. (The) .....	327,249	11,898,782	1.4
Nishirei Corp. ....	341,015	7,514,522	0.9
Nomad Foods Ltd. ....	326,849	8,230,058	1.0
Salmar ASA .....	38,923	2,859,810	0.4
		<u>30,503,172</u>	<u>3.7</u>
		<u>53,047,466</u>	<u>6.4</u>
<b>VERSORGUNG</b>			
<b>STROMVERSORGUNGSBETRIEBE</b>			
EDP - Energias de Portugal SA .....	3,191,624	15,582,980	1.9
Enel SpA .....	1,816,721	13,387,321	1.6
		<u>28,970,301</u>	<u>3.5</u>
<b>GASVERSORGUNGSBETRIEBE</b>			
China Resources Gas Group Ltd. ....	1,591,525	7,309,864	0.8
Kunlun Energy Co., Ltd. ....	13,365,089	13,147,019	1.6
		<u>20,456,883</u>	<u>2.4</u>
		<u>49,427,184</u>	<u>5.9</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
<b>CHEMIKALIEN</b>					
Tosoh Corp. ....			714,325	\$ 11,084,955	1.3%
<b>METALL UND BERGBAU</b>					
ArcelorMittal SA .....			411,600	12,771,393	1.5
Endeavour Mining PLC .....			365,497	9,673,303	1.2
				22,444,696	2.7
				33,529,651	4.0
<b>IMMOBILIEN</b>					
<b>AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)</b>					
Americold Realty Trust .....			394,158	10,531,914	1.3
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG</b>					
CIFI Holdings Group Co., Ltd. ....			18,012,250	12,549,342	1.5
				23,081,256	2.8
<b>ENERGIE</b>					
<b>ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE</b>					
Shell PLC .....			783,112	20,751,056	2.5
				811,724,333	97.7
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>STAMMAKTIE</b>					
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>					
<b>KFZ-BESTANDTEILE</b>					
Faurecia SE(a) .....			295,420	11,123,746	1.4
<b>Gesamtanlagen</b>					
(Kosten \$804,314,976) .....				\$ 822,848,079	99.1%
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(b) .....	(0.21)%	–		597	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(b) .....	0.00 %	–		12,941	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(b) .....	0.01 %	–		9,341,495	1.1
BBH, Grand Cayman(b) .....	3.00 %	–		325	0.0
BNP Paribas, Paris(b) .....	(0.74)%	–		478	0.0
BNP Paribas, Paris(b) .....	(0.31)%	–		3,782	0.0
BNP Paribas, Paris(b) .....	0.00 %	–		80,976	0.0
BNP Paribas, Paris(b) .....	0.07 %	–		4,275	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(b) .....	(1.54)%	–		1,732	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(b) .....	(0.78)%	–		80,501	0.0
SEB, Stockholm(b) .....	0.01 %	–		3,636	0.0
SEB, Stockholm(b) .....	0.10 %	–		1,342	0.0
Sumitomo, London(b) .....	0.10 %	–		386,134	0.0
<b>Termineinlagen insgesamt</b> .....				9,918,214	1.1
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> .....				(2,054,225)	(0.2)
<b>Nettovermögen</b> .....				\$ 830,712,068	100.0%

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA .....	KRW 25,686,963	USD 21,587	04/28/2022	\$ 239,643
BNP Paribas SA .....	CNH 391,993	USD 61,283	05/18/2022	(442,847)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 1,052	EUR 928	05/12/2022	(8,336)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	AUD 2,440	USD 1,752	03/18/2022	(20,501)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	CAD 453	USD 355	03/18/2022	(2,472)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 35	USD 39	03/18/2022	383
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 18	USD 20	03/18/2022	(183)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	GBP 746	USD 1,012	03/18/2022	11,769
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	GBP 350	USD 466	03/18/2022	(3,912)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	SGD 314	USD 233	03/18/2022	1,786
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	SGD 151	USD 111	03/18/2022	(351)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 26,601	AUD 37,099	03/18/2022	350,856
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 4,849	CAD 6,155	03/18/2022	7,553
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 1,175	EUR 1,033	03/18/2022	(15,145)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 25,650	GBP 18,896	03/18/2022	(298,129)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 6,500	SGD 8,736	03/18/2022	(57,405)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 5,613	ZAR 85,012	03/18/2022	(96,074)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	ZAR 3,308	USD 219	03/18/2022	3,843
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	ZAR 1,488	USD 96	03/18/2022	(610)
Citibank, NA .....	EUR 2,611	USD 2,971	05/12/2022	35,482



Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citibank, NA .....	USD	5,652	EUR	4,970	05/12/2022	\$ (64,311)
Citibank, NA .....	USD	1,832	CNH	11,673	05/18/2022	6,266
Deutsche Bank AG .....	ILS	14,395	USD	4,593	03/03/2022	109,269
Deutsche Bank AG .....	USD	604	ILS	1,938	03/03/2022	(635)
HSBC Bank USA .....	ILS	12,707	USD	4,080	03/03/2022	122,566
HSBC Bank USA .....	USD	2,148	ILS	6,885	03/03/2022	(3,137)
Morgan Stanley Capital Services LLC .....	MXN	249,401	USD	12,094	03/24/2022	(34,784)
Morgan Stanley Capital Services LLC .....	EUR	2,914	USD	3,315	05/12/2022	38,523
Morgan Stanley Capital Services LLC .....	USD	7,523	EUR	6,734	05/12/2022	48,043
Morgan Stanley Capital Services LLC .....	USD	3,762	EUR	3,308	05/12/2022	(42,957)
Morgan Stanley Capital Services LLC .....	USD	4,393	CNH	27,882	05/18/2022	(2,522)
Standard Chartered Bank .....	TWD	359,077	USD	12,921	04/29/2022	81,684
UBS AG .....	EUR	40,015	USD	45,789	05/12/2022	797,073
						\$ 760,428
					Wertsteigerung	\$ 1,854,739
					Wertminderung	\$ (1,094,311)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

**Währungskürzel:**

- AUD – Australian Dollar
- CAD – Canadian Dollar
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- EUR – Euro
- GBP – Great British Pound
- ILS – Israeli Shekel
- KRW – South Korean Won
- MXN – Mexican Peso
- SGD – Singapore Dollar
- TWD – New Taiwan Dollar
- USD – United States Dollar
- ZAR – South African Rand

**Glossar:**

- REG – Registered Shares
- REIT – Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
Samsung SDI Co., Ltd. ....	40,360	\$ 18,599,517	3.1%
Sinbon Electronics Co., Ltd. ....	1,609,000	15,468,409	2.6
		<u>34,067,926</u>	<u>5.7</u>
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>			
FPT Corp. ....	166,568	683,203	0.1
GDS Holdings Ltd. ....	2,671,480	14,629,295	2.4
Network International Holdings PLC(a) ....	136,821	411,903	0.1
		<u>15,724,401</u>	<u>2.6</u>
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>			
Broadcom, Inc. ....	14,060	8,259,406	1.4
MediaTek, Inc. ....	466,000	18,414,385	3.1
Realtek Semiconductor Corp. ....	92,000	1,516,893	0.2
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. ....	2,634,000	56,629,837	9.5
		<u>84,820,521</u>	<u>14.2</u>
<b>TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE</b>			
Samsung Electronics Co., Ltd. ....	50,110	3,019,298	0.5
		<u>137,632,146</u>	<u>23.0</u>
<b>FINANZWERTE</b>			
<b>BANKEN</b>			
Al Rajhi Bank ....	178,670	7,665,249	1.3
Bandhan Bank Ltd. ....	467,883	1,908,172	0.3
Bank for Foreign Trade of Vietnam JSC ....	3,227,807	11,957,461	2.0
Bank Mandiri Persero TBK PT ....	34,007,000	18,385,596	3.1
Grupo Financiero Banorte SAB de CV - Class O ....	1,192,970	8,095,840	1.3
HDFC Bank Ltd. ....	1,161,697	22,052,216	3.7
		<u>70,064,534</u>	<u>11.7</u>
<b>FINANZWESEN – VERBRAUCHER</b>			
Manappuram Finance Ltd. ....	1,851,303	2,838,089	0.5
Muangthai Capital PCL ....	3,408,700	5,372,549	0.9
Muthoot Finance Ltd. ....	174,465	3,160,861	0.5
		<u>11,371,499</u>	<u>1.9</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>			
AIA Group Ltd. ....	1,838,600	19,091,737	3.2
Max Financial Services Ltd. ....	746,394	8,336,500	1.4
		<u>27,428,237</u>	<u>4.6</u>
<b>SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG</b>			
Housing Development Finance Corp., Ltd. ....	723,677	22,872,399	3.9
		<u>131,736,669</u>	<u>22.1</u>
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>KRAFTFAHRZEUGE</b>			
NIO, Inc. (ADR) ....	375,310	8,572,080	1.4
<b>HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT</b>			
Despegar.com Corp. ....	1,150,020	13,236,730	2.2
Galaxy Entertainment Group Ltd. ....	1,014,000	5,655,313	1.0
MakeMyTrip Ltd. ....	474,940	13,336,315	2.2
OPAP SA ....	1,230,219	17,930,109	3.0
		<u>50,158,467</u>	<u>8.4</u>
<b>EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB</b>			
Alibaba Group Holding Ltd. ....	396,200	5,215,528	0.9
JD.com, Inc. - Class A ....	687,103	24,542,939	4.1
Meituan - Class B ....	272,200	6,046,966	1.0
		<u>35,805,433</u>	<u>6.0</u>
<b>SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL</b>			
China Tourism Group Duty Free Corp., Ltd. - Class A ....	236,400	7,635,463	1.3
<b>TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER</b>			
ANTA Sports Products Ltd. ....	394,800	6,029,865	1.0
Samsonite International SA ....	6,241,500	13,975,209	2.4
		<u>20,005,074</u>	<u>3.4</u>
		<u>122,176,517</u>	<u>20.5</u>
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN</b>			
<b>UNTERHALTUNG</b>			
NCSOFT Corp. ....	9,920	3,674,814	0.6

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
NAVER Corp. ....	74,750	\$ 19,917,694	3.3%
Tencent Holdings Ltd. ....	847,500	45,732,221	7.7
		<u>65,649,915</u>	<u>11.0</u>
		<u>69,324,729</u>	<u>11.6</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>			
<b>LUFTFRACHT UND LOGISTIK</b>			
InPost SA(a) ....	884,030	5,459,425	0.9
<b>GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF</b>			
Sunny Friend Environmental Technology Co., Ltd. ....	1,459,000	10,380,738	1.7
<b>BAU- UND INGENIEURWESEN</b>			
Sinopec Engineering Group Co., Ltd. - Class H ....	20,694,500	9,899,956	1.7
<b>STRASSE UND SCHIENE</b>			
Globaltrans Investment PLC (Sponsored GDR) ....	1,018,823	1,935,764	0.3
		<u>27,675,883</u>	<u>4.6</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
<b>GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF</b>			
AK Medical Holdings Ltd.(a) ....	538,800	371,092	0.1
<b>GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Universal Vision Biotechnology Co., Ltd. ....	1,143,000	11,104,747	1.8
<b>PHARMAZEUTIKA</b>			
Genomma Lab Internacional SAB de CV - Class B ....	14,465,696	13,186,590	2.2
		<u>24,662,429</u>	<u>4.1</u>
<b>GRUNDSTOFFE</b>			
<b>CHEMIKALIEN</b>			
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA (Sponsored ADR) ....	96,260	6,370,487	1.1
<b>METALL UND BERGBAU</b>			
Freeport-McMoRan, Inc. ....	270,700	12,709,365	2.1
		<u>19,079,852</u>	<u>3.2</u>
<b>IMMOBILIEN</b>			
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG</b>			
A-Living Smart City Services Co., Ltd. - Class H ....	3,079,750	5,520,520	0.9
China Overseas Property Holdings Ltd. ....	1,305,000	1,416,884	0.2
Country Garden Services Holdings Co., Ltd. ....	1,772,000	10,600,029	1.8
		<u>17,537,433</u>	<u>2.9</u>
<b>VERSORGUNG</b>			
<b>STROMVERSORGUNGSBETRIEBE</b>			
Equatorial Energia SA ....	3,182,500	15,738,405	2.6
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>			
<b>LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL</b>			
Dino Polska SA ....	86,370	6,073,269	1.0
		<u>571,637,332</u>	<u>95.6</u>
<b>AKTIENANLEIHEN</b>			
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>			
FPT Corp. Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023 ....	3,431,394	14,035,469	2.3
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>SPEZIALISIRTER EINZELHANDEL</b>			
Mobile World Investment Corp. Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023 ....	865,939	5,162,985	0.9
		<u>19,198,454</u>	<u>3.2</u>
<b>Gesamtanlagen</b>			
(Kosten \$593,033,453) .....		\$ 590,835,786	98.8%
<b>Termineinlagen</b>			
ANZ, London(b) ....	(0.21)%	–	4,570
Bank of Nova Scotia, Toronto(b) .....	0.01 %	–	113
BBH, Grand Cayman(b) .....	3.00 %	–	72,152
BNP Paribas, Paris(b) .....	(0.31)%	–	96
BNP Paribas, Paris(b) .....	0.01 %	–	291,521
BNP Paribas, Paris(b) .....	0.08 %	–	50,603
Credit Suisse AG, Zurich(b) .....	(1.54)%	–	1,150
SEB, Stockholm(b) .....	(0.78)%	–	61,916
SEB, Stockholm(b) .....	0.10 %	–	184,707
Sumitomo, Tokyo(b) .....	0.01 %	–	10,763,607
<b>Termineinlagen insgesamt</b> .....			<u>11,430,435</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> .....			<u>(4,552,370)</u>
<b>Nettovermögen</b> .....		\$ 597,713,851	100.0%

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	AUD	235	USD	169	03/18/2022	\$ (1,596)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	PLN	59	USD	15	03/18/2022	468
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	PLN	15	USD	3	03/18/2022	(33)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	SGD	2	USD	2	03/18/2022	8
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	SGD	0*	USD	0*	03/18/2022	(1)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	USD	2,791	AUD	3,893	03/18/2022	36,905
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	USD	301	PLN	1,191	03/18/2022	(17,087)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	USD	31	SGD	41	03/18/2022	(272)
						<u>\$ 18,392</u>
					Wertsteigerung	\$ 37,381
					Wertminderung	\$ (18,989)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

\* 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 %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>FINANZWERTE</b>			
<b>BANKEN</b>			
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	19,838,500	\$ 11,046,704	3.2%
Bank of the Philippine Islands	1,659,770	3,237,312	0.9
BOC Hong Kong Holdings Ltd.	876,500	3,151,748	0.9
China Construction Bank Corp. - Class H	11,048,000	8,284,657	2.4
Dah Sing Financial Holdings Ltd.	416,200	1,344,797	0.4
Hana Financial Group, Inc.	340,200	13,779,465	3.9
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A	1,914,000	6,687,243	1.9
KB Financial Group, Inc.	318,530	15,815,895	4.5
Metropolitan Bank & Trust Co.	2,909,280	3,240,099	0.9
Ping An Bank Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	1,789,900	4,462,849	1.3
State Bank of India	772,402	4,953,378	1.4
United Bank Ltd./Pakistan	1,136,200	954,575	0.3
		<u>76,958,722</u>	<u>22.0</u>
<b>DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN</b>			
Metro Pacific Investments Corp.	23,378,000	1,760,076	0.5
		<u>78,718,798</u>	<u>22.5</u>
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
E Ink Holdings, Inc.	254,000	1,336,365	0.4
Tong Hsing Electronic Industries Ltd.	40,000	410,915	0.1
		<u>1,747,280</u>	<u>0.5</u>
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Vnet Group, Inc. (ADR)	352,000	2,770,240	0.8
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>			
Himax Technologies, Inc. (ADR)(a)	136,970	1,521,737	0.4
King Yuan Electronics Co., Ltd.	1,646,000	2,553,986	0.7
Novatek Microelectronics Corp.	309,000	5,031,514	1.4
Powerchip Semiconductor Manufacturing Corp.	931,783	1,771,501	0.5
SK Hynix, Inc.	29,490	3,029,080	0.9
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	1,106,000	23,828,215	6.8
United Microelectronics Corp.	6,319,000	11,743,175	3.4
		<u>49,479,208</u>	<u>14.1</u>
<b>TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE</b>			
Asia Vital Components Co., Ltd.	451,000	1,769,574	0.5
		<u>55,766,302</u>	<u>15.9</u>
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>KRAFTFAHRZEUGE</b>			
Astra International Tbk PT	9,910,000	4,000,696	1.1
Dongfeng Motor Group Co., Ltd. - Class H	2,528,000	2,170,665	0.6
Great Wall Motor Co., Ltd. - Class H	2,246,000	4,673,299	1.3
Hyundai Motor Co.	20,510	2,985,196	0.9
Kia Corp.	119,840	7,355,755	2.1
Maruti Suzuki India Ltd.	73,184	8,075,420	2.3
		<u>29,261,031</u>	<u>8.3</u>
<b>HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT</b>			
Galaxy Entertainment Group Ltd.	841,000	4,676,049	1.3
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	691,200	1,282,522	0.4
		<u>5,958,571</u>	<u>1.7</u>
<b>EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB</b>			
Alibaba Group Holding Ltd.	420,900	5,612,287	1.6
JD.com, Inc. - Class A	8,395	299,937	0.1
		<u>5,912,224</u>	<u>1.7</u>
<b>MULTILINE-EINZELHANDEL</b>			
Matahari Department Store Tbk PT	5,213,500	1,658,362	0.5
<b>SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL</b>			
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	764,500	5,321,936	1.5
<b>TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER</b>			
Samsonite International SA	2,184,900	4,864,902	1.4
		<u>52,977,026</u>	<u>15.1</u>
<b>VERSORGUNG</b>			
<b>STROMVERSORGUNGSBETRIEBE</b>			
Power Grid Corp. of India Ltd.	2,270,616	6,277,173	1.8

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>GASVERSORGUNGSBETRIEBE</b>			
ENN Energy Holdings Ltd. ....	53,800	\$ 780,708	0.2%
GAIL India Ltd. ....	3,088,300	5,934,979	1.7
Kunlun Energy Co., Ltd. ....	5,916,000	5,783,820	1.6
		<u>12,499,507</u>	<u>3.5</u>
<b>UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN</b>			
China Datang Corp. Renewable Power Co., Ltd.(a) ....	12,918,000	4,876,526	1.4
China Longyuan Power Group Corp., Ltd. - Class H ....	4,624,000	9,467,407	2.7
China Yangtze Power Co., Ltd. - Class A ....	1,452,200	5,328,964	1.5
Xinyi Energy Holdings Ltd. ....	3,228,000	1,652,292	0.5
		<u>21,325,189</u>	<u>6.1</u>
		<u>40,101,869</u>	<u>11.4</u>
<b>IMMOBILIEN</b>			
<b>AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)</b>			
CapitalLand Integrated Commercial Trust ....	2,480,600	3,860,785	1.1
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG</b>			
Ayala Land, Inc. ....	6,037,900	4,592,902	1.3
China Resources Land Ltd. ....	1,246,000	6,058,915	1.7
CIFI Holdings Group Co., Ltd. ....	5,579,100	3,883,795	1.1
Longfor Group Holdings Ltd. ....	1,072,500	5,736,762	1.6
Megaworld Corp. ....	31,599,000	1,972,241	0.6
Midea Real Estate Holding Ltd.(a) ....	1,482,600	2,170,417	0.6
Poly Developments and Holdings Group Co., Ltd. - Class A ....	2,365,800	5,924,987	1.7
Times China Holdings Ltd. ....	2,749,000	889,997	0.3
		<u>31,230,016</u>	<u>8.9</u>
		<u>35,090,801</u>	<u>10.0</u>
<b>GRUNDSTOFFE</b>			
<b>CHEMIKALIEN</b>			
Hansol Chemical Co., Ltd. ....	31,090	5,546,476	1.6
LB Group Co., Ltd. - Class A ....	449,800	1,883,423	0.5
		<u>7,429,899</u>	<u>2.1</u>
<b>BAUMATERIAL</b>			
Gansu Shangfeng Cement Co., Ltd. - Class A ....	523,600	1,765,559	0.5
<b>METALL UND BERGBAU</b>			
Baoshan Iron & Steel Co., Ltd. - Class A ....	1,261,100	1,441,417	0.4
China Hongqiao Group Ltd. ....	1,898,500	2,638,357	0.8
Hindalco Industries Ltd. ....	363,545	2,768,293	0.8
POSCO ....	15,780	3,740,425	1.1
		<u>10,588,492</u>	<u>3.1</u>
		<u>19,783,950</u>	<u>5.7</u>
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN</b>			
<b>DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>			
Telkom Indonesia Persero Tbk PT ....	15,233,000	4,601,602	1.3
<b>UNTERHALTUNG</b>			
International Games System Co., Ltd. ....	116,000	2,846,727	0.8
<b>INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Tencent Holdings Ltd. ....	170,900	9,211,358	2.6
<b>MEDIEN</b>			
Media Nusantara Citra TBK PT ....	26,879,000	1,627,670	0.5
		<u>18,287,357</u>	<u>5.2</u>
<b>ENERGIE</b>			
<b>ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE</b>			
China Oilfield Services Ltd. - Class H ....	5,984,000	6,769,196	2.0
<b>ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE</b>			
PetroChina Co., Ltd. - Class H ....	15,266,000	8,146,191	2.3
		<u>14,915,387</u>	<u>4.3</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>			
<b>ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG</b>			
NARI Technology Co., Ltd. - Class A ....	1,189,720	6,657,897	1.9
<b>INDUSTRIEKONZERNE</b>			
Ayala Corp. ....	114,530	1,898,781	0.5
		<u>8,556,678</u>	<u>2.4</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>			
<b>GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd. - Class H ....	2,066,200	3,722,788	1.1

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>					
<b>LEBENSMITTELPRODUKTE</b>					
WH Group Ltd. ....			1,670,148	\$ 1,164,782	0.3%
				<u>329,085,738</u>	<u>93.9</u>
<b>AKTIENANLEIHEN</b>					
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>					
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>					
FPT Corp., Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023 .....			1,996,824	8,167,631	2.4
<b>IMMOBILIEN</b>					
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG</b>					
Vincom Retail, Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023 .....			4,067,560	5,975,148	1.7
Vinhomes JSC, Macquarie Bank Ltd., expiring 06/06/2022 .....			526,800	1,789,873	0.5
				<u>7,765,021</u>	<u>2.2</u>
<b>FINANZWERTE</b>					
<b>BANKEN</b>					
Military Commercial Joint Stock Bank, Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023 .....			922,827	1,391,725	0.4
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>					
<b>SPEZIALISIRTER EINZELHANDEL</b>					
Mobile World Investment Corp., Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023 .....			229,950	1,371,030	0.4
				<u>18,695,407</u>	<u>5.4</u>
<b>Gesamtanlagen</b>				<u>\$ 347,781,145</u>	<u>99.3%</u>
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(b) .....	(0.21)%	–		210	0.0
BBH, Grand Cayman(b) .....	0.25 %	–		2	0.0
BBH, Grand Cayman(b) .....	3.00 %	–		3,588	0.0
BNP Paribas, Paris(b) .....	0.01 %	–		11,936	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Singapore(b) .....	0.08 %	–		35,126	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(b) .....	(0.78)%	–		1	0.0
Sumitomo, London(b) .....	0.10 %	–		28	0.0
<b>Termineinlagen insgesamt.</b> .....				<u>50,891</u>	<u>0.0</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> .....				<u>2,507,175</u>	<u>0.7</u>
<b>Nettovermögen</b> .....				<u>\$ 350,339,211</u>	<u>100.0%</u>

**DEWISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	CNH 6	USD 1	03/04/2022	\$ (3)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 18	CNH 112	03/04/2022	87
Brown Brothers Harriman & Co. ....	AUD 3,461	USD 2,496	03/18/2022	(18,444)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	CAD 424	USD 333	03/18/2022	(1,584)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	EUR 20	USD 23	03/18/2022	104
Brown Brothers Harriman & Co. ....	GBP 86	USD 116	03/18/2022	1,225
Brown Brothers Harriman & Co. ....	GBP 116	USD 155	03/18/2022	(353)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	NZD 85	USD 57	03/18/2022	37
Brown Brothers Harriman & Co. ....	NZD 312	USD 209	03/18/2022	(2,194)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	SGD 5	USD 3	03/18/2022	10
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 32,412	AUD 45,203	03/18/2022	427,493
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 5,889	CAD 7,475	03/18/2022	8,961
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 555	EUR 488	03/18/2022	(7,159)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 1	GBP 1	03/18/2022	2
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 5,655	GBP 4,166	03/18/2022	(65,734)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 4,169	NZD 6,263	03/18/2022	67,560
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 1	NZD 1	03/18/2022	0
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 84	SGD 113	03/18/2022	(744)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 15,828	ZAR 239,706	03/18/2022	(271,628)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	ZAR 11,688	USD 770	03/18/2022	11,127
				<u>\$ 148,763</u>
			Wertsteigerung	\$ 516,606
			Wertminderung	\$ (367,843)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

**Währungskürzel:**

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

**Glossar:**

- ADR – American Depositary Receipt  
JSC – Joint Stock Company  
REIT – Real Estate Investment Trust



	Anteile	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>KFZ-BESTANDTEILE</b>			
NGK Spark Plug Co., Ltd. ....	49,100	¥ 101,538,800	1.4%
Sumitomo Electric Industries, Ltd. ....	111,900	170,367,750	2.4
Toyo Tire Corp. ....	103,900	157,824,100	2.2
TS Tech Co., Ltd. ....	35,200	54,419,200	0.7
		<u>484,149,850</u>	<u>6.7</u>
<b>KRAFTFAHRZEUGE</b>			
Honda Motor Co., Ltd. ....	65,900	232,297,500	3.2
Suzuki Motor Corp. ....	39,300	179,718,900	2.5
		<u>412,016,400</u>	<u>5.7</u>
<b>DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE</b>			
Benesse Holdings, Inc. ....	50,500	118,069,000	1.6
<b>HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER</b>			
Panasonic Corp. ....	57,800	68,782,000	0.9
Sony Group Corp. ....	18,700	220,847,000	3.1
		<u>289,629,000</u>	<u>4.0</u>
<b>EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB</b>			
ASKUL Corp. ....	76,300	126,429,100	1.8
<b>SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL</b>			
ABC-Mart, Inc. ....	13,100	65,238,000	0.9
		<u>1,495,531,350</u>	<u>20.7</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>			
<b>GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF</b>			
Park24 Co., Ltd. ....	50,500	86,456,000	1.2
<b>ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG</b>			
Fuji Electric Co., Ltd. ....	20,700	121,302,000	1.7
<b>INDUSTRIEKONZERNE</b>			
Hitachi Ltd. ....	27,500	155,375,000	2.1
<b>MASCHINEN</b>			
IHI Corp. ....	20,600	54,754,800	0.8
Toyota Industries Corp. ....	13,700	119,738,000	1.6
		<u>174,492,800</u>	<u>2.4</u>
<b>PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Outsourcing, Inc. ....	82,300	115,878,400	1.6
UT Group Co., Ltd. ....	36,800	127,880,000	1.8
		<u>243,758,400</u>	<u>3.4</u>
<b>STRASSE UND SCHIENE</b>			
East Japan Railway Co. ....	18,900	128,709,000	1.8
Sankyu, Inc. ....	28,000	111,580,000	1.5
		<u>240,289,000</u>	<u>3.3</u>
<b>HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER</b>			
Mitsubishi Corp. ....	55,000	212,905,000	2.9
		<u>1,234,578,200</u>	<u>17.0</u>
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>			
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>			
Ok Electric Industry Co., Ltd. ....	144,400	121,873,600	1.7
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Fujitsu Ltd. ....	6,900	114,298,500	1.6
NEC Networks & System Integration Corp. ....	57,600	101,145,600	1.4
Nihon Unisys Ltd. ....	33,700	105,312,500	1.4
Otsuka Corp. ....	29,700	131,719,500	1.8
		<u>452,476,100</u>	<u>6.2</u>
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>			
Rorze Corp. ....	7,000	74,900,000	1.0
SCREEN Holdings Co., Ltd. ....	18,000	200,160,000	2.8
		<u>275,060,000</u>	<u>3.8</u>
<b>SOFTWARE</b>			
Oracle Corp., Japan ....	4,500	36,720,000	0.5
		<u>886,129,700</u>	<u>12.2</u>
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>			
<b>GETRÄNKE</b>			
Asahi Group Holdings Ltd. ....	18,636	86,545,584	1.2
Coca-Cola Bottlers Japan Holdings, Inc. ....	35,100	51,526,800	0.7

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (JPY)	Nettovermögen %
Kirin Holdings Co., Ltd. ....			31,300	¥ 59,704,750	0.8%
				<u>197,777,134</u>	<u>2.7</u>
<b>LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL</b>					
Seven & i Holdings Co., Ltd.(a) .....			32,900	183,943,900	2.5
Sundrug Co., Ltd. ....			27,000	84,240,000	1.2
				<u>268,183,900</u>	<u>3.7</u>
<b>LEBENSMITTELPRODUKTE</b>					
Morinaga & Co., Ltd./Japan .....			12,000	44,880,000	0.6
Nichirei Corp. ....			53,000	134,249,000	1.9
				<u>179,129,000</u>	<u>2.5</u>
<b>KÖRPERPFLEGEPRODUKTE</b>					
Pola Orbis Holdings, Inc. ....			53,800	96,624,800	1.3
<b>TABAK</b>					
Japan Tobacco, Inc. ....			15,700	33,284,000	0.5
				<u>774,998,834</u>	<u>10.7</u>
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN</b>					
<b>DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>					
Nippon Telegraph & Telephone Corp. ....			106,400	350,375,200	4.8
<b>UNTERHALTUNG</b>					
Konami Holdings Corp. ....			28,400	184,032,000	2.6
<b>INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Dip Corp. ....			21,100	71,529,000	1.0
				<u>605,936,200</u>	<u>8.4</u>
<b>FINANZWERTE</b>					
<b>BANKEN</b>					
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. ....			341,800	243,635,040	3.4
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. ....			49,500	203,989,500	2.8
				<u>447,624,540</u>	<u>6.2</u>
<b>DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN</b>					
ORIX Corp. ....			60,800	138,806,400	1.9
				<u>586,430,940</u>	<u>8.1</u>
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
<b>CHEMIKALIEN</b>					
Air Water, Inc. ....			70,200	117,374,400	1.6
Tosoh Corp. ....			75,500	134,994,000	1.9
Zeon Corp. ....			71,900	96,705,500	1.3
				<u>349,073,900</u>	<u>4.8</u>
<b>CONTAINER UND VERPACKUNGEN</b>					
Rengo Co., Ltd. ....			125,000	107,500,000	1.5
<b>METALL UND BERGBAU</b>					
Sumitomo Metal Mining Co., Ltd. ....			17,200	98,831,200	1.4
				<u>555,405,100</u>	<u>7.7</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>					
<b>PHARMAZEUTIKA</b>					
Nippon Shinyaku Co., Ltd. ....			28,300	210,835,000	2.9
Santen Pharmaceutical Co., Ltd. ....			76,600	99,886,400	1.4
				<u>310,721,400</u>	<u>4.3</u>
<b>IMMOBILIEN</b>					
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG</b>					
Daito Trust Construction Co., Ltd. ....			7,000	89,040,000	1.2
Mitsui Fudosan Co., Ltd. ....			78,300	200,213,100	2.8
				<u>289,253,100</u>	<u>4.0</u>
<b>ENERGIE</b>					
<b>ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE</b>					
ENEOS Holdings, Inc. ....			458,700	208,158,060	2.9
<b>Gesamtanlagen</b>					
(Kosten ¥6,915,640,429) .....				¥ 6,947,142,884	96.0%
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(b) .....	0.21%	–		35,180	0.0
BBH, Grand Cayman(b) .....	0.08 %	–		2	0.0
BBH, Grand Cayman(b) .....	0.25 %	–		20,752	0.0
BBH, Grand Cayman(b) .....	3.00 %	–		161,073	0.0
BNP Paribas, Paris(b) .....	0.31%	–		364,914,251	5.1
SEB, Stockholm(b) .....	0.01 %	–		2,109,969	0.0
<b>Termineinlagen insgesamt</b> .....				<u>367,241,227</u>	<u>5.1</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> .....				<u>(76,787,600)</u>	<u>(1.1)</u>
<b>Nettovermögen</b> .....				<u>¥ 7,237,596,511</u>	<u>100.0%</u>

**DEVISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD 194	JPY 16,139	03/18/2022	¥ (27,652)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CZK 16	JPY 82	03/18/2022	2,324
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 23	JPY 2,976	03/18/2022	29,745
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY 437,763	AUD 5,288	03/18/2022	3,690,131
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY 2,228	CZK 416	03/18/2022	(103,878)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY 58,606	EUR 447	03/18/2022	(1,008,559)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY 54,666	NZD 711	03/18/2022	641,248
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY 844	SGD 10	03/18/2022	(11,270)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY 787,316	USD 6,820	03/18/2022	(3,580,681)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY 37,609	ZAR 4,937	03/18/2022	(791,646)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	NZD 9	JPY 685	03/18/2022	(8,239)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	NZD 26	JPY 1,999	03/18/2022	3,791
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 0*	JPY 31	03/18/2022	241
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 10	JPY 1,149	03/18/2022	(193)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 511	JPY 58,918	03/18/2022	147,506
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR 244	JPY 1,857	03/18/2022	37,218
				¥ (979,914)
			Wertsteigerung	¥ 4,552,204
			Wertminderung	¥ (5,532,118)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

\* 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
- 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 %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>			
<b>STAMMAKTIE</b>			
<b>NICHT-BASISKONSUMGÜTER</b>			
<b>KRAFTFAHRZEUGE</b>			
Great Wall Motor Co., Ltd. - Class H	545,000	\$ 1,133,993	0.8%
XPeng, Inc. (ADR)	38,370	1,395,517	1.0
		<u>2,529,510</u>	<u>1.8</u>
<b>HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT</b>			
Jiumaojiu International Holdings Ltd.(a)	981,000	2,189,317	1.6
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	1,375,600	2,552,428	1.9
		<u>4,741,745</u>	<u>3.5</u>
<b>EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB</b>			
Alibaba Group Holding Ltd.	395,560	5,274,403	3.8
JD.com, Inc. - Class A	83,776	2,993,148	2.2
Meituan - Class B	91,900	2,025,079	1.5
		<u>10,292,630</u>	<u>7.5</u>
<b>SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL</b>			
Topsports International Holdings Ltd.	1,074,000	1,111,850	0.8
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	277,000	1,928,288	1.4
		<u>3,040,138</u>	<u>2.2</u>
<b>TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER</b>			
Bosideng International Holdings Ltd.(a)	3,082,000	1,751,092	1.3
Li Ning Co., Ltd.	253,000	2,513,942	1.8
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1,960	1,450,229	1.0
Samsonite International SA	528,900	1,177,649	0.9
Shenzhou International Group Holdings Ltd.	89,000	1,495,368	1.1
Stella International Holdings Ltd.	1,642,000	1,668,349	1.2
		<u>10,056,629</u>	<u>7.3</u>
		<u>30,660,652</u>	<u>22.3</u>
<b>FINANZWERTE</b>			
<b>BANKEN</b>			
Agricultural Bank of China Ltd. - Class H	4,584,000	1,736,319	1.2
Bank of Hangzhou Co., Ltd. - Class A	963,200	2,183,546	1.6
China Construction Bank Corp. - Class H	9,642,100	7,230,403	5.2
China Merchants Bank Co., Ltd. - Class H	321,500	2,707,074	2.0
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A	827,900	2,892,565	2.1
Ping An Bank Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	869,236	2,167,310	1.6
		<u>18,917,217</u>	<u>13.7</u>
<b>KAPITALMÄRKTE</b>			
CITIC Securities Co., Ltd. - Class H	547,400	1,326,716	1.0
Haitong Securities Co., Ltd. - Class H	837,600	720,277	0.5
		<u>2,046,993</u>	<u>1.5</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>			
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	394,000	3,045,274	2.2
		<u>24,009,484</u>	<u>17.4</u>
<b>KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN</b>			
<b>UNTERHALTUNG</b>			
G-bits Network Technology Xiamen Co., Ltd. - Class A	37,600	2,081,905	1.5
<b>INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN</b>			
Tencent Holdings Ltd.	217,900	11,744,616	8.5
<b>MEDIEN</b>			
Chinese Universe Publishing and Media Group Co., Ltd.	867,700	1,597,542	1.2
		<u>15,424,063</u>	<u>11.2</u>
<b>VERBRAUCHSGÜTER</b>			
<b>GETRÄNKE</b>			
Anhui Yingjia Distillery Co., Ltd. - Class A	186,100	2,179,828	1.6
China Resources Beer Holdings Co., Ltd.	172,000	1,361,324	1.0
Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	5,000	1,417,173	1.0
Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co., Ltd. - Class A	31,500	1,457,264	1.1
Tsingtao Brewery Co., Ltd. - Class H	180,000	1,726,384	1.2
Wuliangye Yibin Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	37,200	1,118,921	0.8
		<u>9,260,894</u>	<u>6.7</u>
<b>LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL</b>			
Taiwan FamilyMart Co., Ltd./Taiwan	206,000	1,634,921	1.2
<b>LEBENSMITTELPRODUKTE</b>			
Nestle SA (REG)	15,440	2,016,577	1.5
<b>KÖRPERPFLEGEPRODUKTE</b>			
L'Occitane International SA	581,250	2,008,260	1.4
		<u>14,920,652</u>	<u>10.8</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>VERSORGUNG</b>					
<b>GASVERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
ENN Energy Holdings Ltd. ....			90,000	\$ 1,306,017	0.9%
Kunlun Energy Co., Ltd. ....			4,370,000	4,272,362	3.1
				<u>5,578,379</u>	<u>4.0</u>
<b>UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN</b>					
China Datang Corp. Renewable Power Co., Ltd.(a) .....			3,713,000	1,401,652	1.0
China Yangtze Power Co., Ltd. - Class A .....			747,300	2,742,277	2.0
Huaneng Lancang River Hydropower, Inc. - Class A (Nth SSE-SEHK) .....			2,442,300	2,381,676	1.7
Xinyi Energy Holdings Ltd.(a) .....			3,086,000	1,579,607	1.2
				<u>8,105,212</u>	<u>5.9</u>
				<u>13,683,591</u>	<u>9.9</u>
<b>INDUSTRIEGÜTER</b>					
<b>ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG</b>					
Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK) .....			16,200	1,367,849	1.0
NARI Technology Co., Ltd. - Class A .....			604,146	3,380,915	2.4
				<u>4,748,764</u>	<u>3.4</u>
<b>INDUSTRIEKONZERNE</b>					
Guoco Group Ltd. ....			91,000	995,637	0.7
<b>MASCHINEN</b>					
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co., Ltd. - Class A .....			122,500	1,303,773	1.0
				<u>7,048,174</u>	<u>5.1</u>
<b>IMMOBILIEN</b>					
<b>IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG</b>					
China Resources Land Ltd. ....			354,000	1,721,394	1.3
KWG Living Group Holdings Ltd. ....			323,600	133,753	0.1
Longfor Group Holdings Ltd. ....			521,500	2,789,484	2.0
Midea Real Estate Holding Ltd.(a) .....			682,000	998,398	0.7
Poly Developments and Holdings Group Co., Ltd. - Class A .....			513,300	1,285,525	0.9
				<u>6,928,554</u>	<u>5.0</u>
<b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>					
<b>ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN</b>					
GoerTek, Inc. - Class A (Nth SZ-SEHK) .....			297,700	2,063,277	1.5
<b>IT-DIENSTLEISTUNGEN</b>					
GDS Holdings Ltd. ....			393,560	2,163,054	1.6
Vnet Group, Inc. (ADR) .....			51,290	403,652	0.3
				<u>2,566,706</u>	<u>1.9</u>
<b>HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG</b>					
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. ....			71,000	1,529,659	1.1
				<u>6,159,642</u>	<u>4.5</u>
<b>GESUNDHEITSWESEN</b>					
<b>BIOTECHNOLOGIE</b>					
Chongqing Zhifei Biological Products Co., Ltd. - Class A .....			30,700	628,308	0.5
<b>GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF</b>					
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd. ....			26,100	1,351,566	1.0
<b>GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd. - Class H .....			671,800	1,210,419	0.9
<b>PHARMAZEUTIKA</b>					
Yunnan Baiyao Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK) .....			111,000	1,585,890	1.1
				<u>4,776,183</u>	<u>3.5</u>
<b>ENERGIE</b>					
<b>ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE</b>					
PetroChina Co., Ltd. - Class H .....			5,626,000	3,002,127	2.2
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
<b>CHEMIKALIEN</b>					
Shanghai Putailai New Energy Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK) .....			54,200	1,248,261	0.9
<b>Gesamtanlagen</b>					
(Kosten \$128,409,543) .....				\$ 127,861,383	92.8%
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(b) .....	(0.21)%	–		1,241	0.0
Barclays, London(b) .....	0.01 %	–		11,918,586	8.7
BBH, Grand Cayman(b) .....	0.01 %	–		1	0.0
BBH, Grand Cayman(b) .....	0.08 %	–		1	0.0
BBH, Grand Cayman(b) .....	0.25 %	–		566	0.0

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover- mögen %
BBH, Grand Cayman(b) . . . . .	3.00 %	–	\$ 153,746	0.1%
BNP Paribas, Paris(b) . . . . .	(0.31)%	–	740	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(b) . . . . .	(1.54)%	–	15,484	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b) . . . . .	0.01 %	–	12,533	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(b) . . . . .	(0.78)%	–	21,904	0.0
SEB, Stockholm(b) . . . . .	0.10 %	–	4,494	0.0
<b>Termineinlagen insgesamt . . . . .</b>			<u>12,129,296</u>	<u>8.8</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten . . . . .</b>			<u>(2,176,179)</u>	<u>(1.6)</u>
<b>Nettovermögen . . . . .</b>			<u>\$ 137,814,500</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	CNH	5	USD 0*	03/04/2022 \$ (2)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	USD	8	CNH 53	03/04/2022 40
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	CNH	4	USD 0*	03/14/2022 (1)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	USD	8	CNH 54	03/14/2022 78
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	AUD	1,276	USD 920	03/18/2022 (6,286)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	CAD	97	USD 76	03/18/2022 (363)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	EUR	15	USD 17	03/18/2022 103
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	GBP	33	USD 45	03/18/2022 449
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	GBP	20	USD 27	03/18/2022 (61)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	NZD	45	USD 30	03/18/2022 19
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	NZD	63	USD 42	03/18/2022 (452)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	PLN	77	USD 19	03/18/2022 506
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	SGD	2	USD 2	03/18/2022 6
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	USD	13,463	AUD 18,776	03/18/2022 177,049
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	USD	1,034	CAD 1,312	03/18/2022 1,509
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	USD	299	EUR 262	03/18/2022 (3,842)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	USD	1,089	GBP 803	03/18/2022 (12,650)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	USD	912	NZD 1,370	03/18/2022 14,773
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	USD	333	PLN 1,324	03/18/2022 (18,608)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	USD	21	SGD 28	03/18/2022 (186)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	USD	17,581	ZAR 266,296	03/18/2022 (298,529)
Brown Brothers Harriman & Co.+ . . . . .	ZAR	17,086	USD 1,126	03/18/2022 17,823
				<u>\$ (128,625)</u>
			Wertsteigerung	\$ 212,355
			Wertminderung	\$ (340,980)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

Glossar:

- ADR – American Depositary Receipt
- REG – Registered Shares

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>					
<b>REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE</b>					
<b>AUSTRALIEN</b>					
Australia Government Bond, Series 139	3.25%	04/21/2025	AUD 56,889	\$ 43,426,718	8.3%
<b>KANADA</b>					
Canadian Government Bond, Series A55	8.00%	06/01/2023	CAD 22,155	18,933,562	3.6
<b>ITALIEN</b>					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4.50%	03/01/2024	EUR 4,460	5,448,453	1.0
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4.50%	03/01/2026	17,741	22,908,540	4.4
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	5.00%	03/01/2025	6,036	7,695,780	1.5
				36,052,773	6.9
<b>JAPAN</b>					
Japan Government Twenty Year Bond, Series 70	2.40%	06/20/2024	JPY 562,634	5,167,770	1.0
Japan Government Twenty Year Bond, Series 71	2.20%	06/20/2024	1,986,053	18,162,214	3.5
				23,329,984	4.5
<b>NEUSEELAND</b>					
New Zealand Government Bond, Series 425	2.75%	04/15/2025	NZD 25,462	17,342,336	3.3
<b>SPANIEN</b>					
Spain Government Bond	4.80%	01/31/2024	EUR 4,161	5,109,054	1.0
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
U.S. Treasury Bonds	7.13%	02/15/2023	USD 29,303	30,950,930	5.9
U.S. Treasury Bonds	7.25%	08/15/2022	8,730	8,982,658	1.7
U.S. Treasury Bonds	7.50%	11/15/2024	34,068	39,423,483	7.6
U.S. Treasury Notes	2.88%	11/30/2023	22,353	22,925,955	4.4
				102,283,026	19.6
				246,477,453	47.2
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
ABN AMRO Bank NV	1.25%	05/28/2025	EUR 1,561	1,774,416	0.3
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series G	1.38%	05/14/2025	1,464	1,665,351	0.3
Banco Santander SA	2.75%	09/12/2023	GBP 1,854	2,507,722	0.5
Bank of America Corp.	1.38%	02/07/2025	EUR 2,069	2,357,932	0.5
Barclays PLC	0.75%	06/09/2025	1,153	1,288,889	0.2
Barclays PLC	3.38%	04/02/2025	585	690,796	0.1
BNP Paribas SA	1.13%	08/28/2024	1,854	2,105,820	0.4
CaixaBank SA	0.63%	10/01/2024	1,756	1,957,588	0.4
Canadian Imperial Bank of Commerce	1.88%	01/27/2026	GBP 1,525	2,018,930	0.4
Citigroup, Inc.	2.01%	01/25/2026	USD 2,084	2,053,800	0.4
Credit Suisse Group AG	1.25%	07/17/2025	EUR 1,747	1,960,600	0.4
Danske Bank A/S	1.63%	03/15/2024	1,733	1,984,547	0.4
Deutsche Bank AG	3.88%	02/12/2024	GBP 1,073	1,471,877	0.3
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	1.76%	01/24/2025	USD 2,083	2,060,746	0.4
HSBC Holdings PLC	1.65%	04/18/2026	2,117	2,041,687	0.4
ING Groep NV	1.13%	02/14/2025	EUR 1,756	1,986,837	0.4
Intesa Sanpaolo SpA	5.25%	01/12/2024	USD 1,475	1,552,744	0.3
JPMorgan Chase & Co.	2.60%	02/24/2026	2,078	2,083,667	0.4
Lloyds Banking Group PLC	2.44%	02/05/2026	2,061	2,044,464	0.4
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	0.98%	10/09/2023	EUR 1,763	2,001,118	0.4
Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.	4.60%	03/27/2024	USD 1,241	1,293,002	0.2
Morgan Stanley	2.63%	02/18/2026	2,078	2,080,025	0.4
Santander UK Group Holdings PLC	3.63%	01/14/2026	GBP 894	1,245,555	0.2
Standard Chartered PLC	2.82%	01/30/2026	USD 1,538	1,529,430	0.3
Swedbank AB	0.25%	10/09/2024	EUR 1,630	1,805,179	0.3
Toronto-Dominion Bank (The)	0.38%	04/25/2024	2,059	2,303,343	0.4
UBS Group AG	1.01%	07/30/2024	USD 790	778,951	0.2
UBS Group AG	2.13%	03/04/2024	EUR 1,122	1,300,279	0.2
UniCredit SpA	3.75%	04/12/2022	USD 1,420	1,423,116	0.3
				51,368,411	9.8
<b>FINANZEN</b>					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	1.65%	10/29/2024	2,119	2,057,740	0.4
Air Lease Corp.	3.88%	07/03/2023	1,268	1,293,712	0.3
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	1,185	1,255,819	0.2
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024	759	778,970	0.2
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	485	515,807	0.1
JAB Holdings BV	1.25%	05/22/2024	EUR 1,756	1,992,164	0.4
Synchrony Financial	4.50%	07/23/2025	USD 1,199	1,257,687	0.2
				9,151,899	1.8

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Berkshire Hathaway, Inc.	0.00%	03/12/2025	EUR 1,855	\$ 2,043,201	0.4%
Metropolitan Life Global Funding I, Series G	2.63%	12/05/2022	GBP 1,142	1,545,747	0.3
				<u>3,588,948</u>	<u>0.7</u>
<b>REITS</b>					
Digital Dutch Finco BV	0.63%	07/15/2025	EUR 1,771	1,953,956	0.4
Heimstaden Bostad Treasury BV	0.25%	10/13/2024	528	582,105	0.1
Host Hotels & Resorts LP, Series E	4.00%	06/15/2025	USD 1,247	1,291,145	0.3
Vornado Realty LP	3.50%	01/15/2025	1,243	1,268,626	0.2
				<u>5,095,832</u>	<u>1.0</u>
				<u>69,205,090</u>	<u>13.3</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Johnson Controls International PLC	1.00%	09/15/2023	EUR 1,748	1,982,310	0.4
Parker-Hannifin Corp.	1.13%	03/01/2025	1,771	2,008,289	0.4
				<u>3,990,599</u>	<u>0.8</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
AT&T, Inc.	2.75%	05/19/2023	1,317	1,523,469	0.3
British Telecommunications PLC	4.50%	12/04/2023	USD 1,996	2,066,324	0.4
				<u>3,589,793</u>	<u>0.7</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
American Honda Finance Corp.	2.63%	10/14/2022	GBP 839	1,135,358	0.2
BMW Finance NV	0.50%	02/22/2025	EUR 749	840,660	0.2
General Motors Financial Co., Inc.	1.69%	03/26/2025	1,105	1,263,158	0.2
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	USD 1,244	1,259,142	0.2
Hyundai Capital America	1.25%	09/18/2023	526	518,584	0.1
Hyundai Capital America	2.85%	11/01/2022	1,544	1,553,976	0.3
Toyota Motor Credit Corp.	0.63%	11/21/2024	EUR 1,140	1,285,263	0.3
Toyota Motor Finance Netherlands BV	0.00%	10/27/2025	721	789,243	0.2
Volkswagen Financial Services AG	0.25%	01/31/2025	966	1,066,990	0.2
Volkswagen Leasing GmbH	1.13%	04/04/2024	908	1,033,199	0.2
				<u>10,745,573</u>	<u>2.1</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
PVH Corp.	4.63%	07/10/2025	USD 1,190	1,257,418	0.2
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
AbbVie, Inc.	1.38%	05/17/2024	EUR 1,522	1,741,444	0.3
Anheuser-Busch InBev SA/NV, Series E	9.75%	07/30/2024	GBP 1,282	2,033,096	0.4
Asahi Group Holdings Ltd.	0.16%	10/23/2024	EUR 1,961	2,173,814	0.4
AstraZeneca PLC	0.75%	05/12/2024	1,090	1,233,798	0.2
Baxter International, Inc.	0.40%	05/15/2024	1,302	1,458,068	0.3
Baxter International, Inc.	1.30%	05/30/2025	376	429,376	0.1
Becton Dickinson and Co.	0.00%	08/13/2023	734	820,027	0.2
Biogen, Inc.	4.05%	09/15/2025	USD 1,981	2,070,760	0.4
Cargill, Inc.	2.50%	02/15/2023	EUR 1,161	1,331,332	0.3
DH Europe Finance II Sarl	0.20%	03/18/2026	1,843	2,008,120	0.4
Diageo Finance PLC	0.13%	10/12/2023	1,356	1,522,168	0.3
Heineken NV	3.40%	04/01/2022	USD 1,464	1,466,979	0.3
Medtronic Global Holdings SCA	0.00%	10/15/2025	EUR 1,817	1,986,516	0.4
Reynolds American, Inc.	4.45%	06/12/2025	USD 1,204	1,260,682	0.2
Thermo Fisher Scientific Finance I BV	0.00%	11/18/2025	EUR 608	663,590	0.1
				<u>22,199,770</u>	<u>4.3</u>
<b>ENERGIE</b>					
BP Capital Markets PLC	1.88%	04/07/2024	1,810	2,086,926	0.4
Cenovus Energy, Inc.	5.38%	07/15/2025	USD 1,168	1,265,119	0.2
Devon Energy Corp.	5.25%	09/15/2024	1,948	2,074,003	0.4
Exxon Mobil Corp.	0.14%	06/26/2024	EUR 2,044	2,278,405	0.4
ONEOK, Inc.	2.20%	09/15/2025	USD 1,289	1,272,122	0.3
Repsol International Finance BV	0.13%	10/05/2024	EUR 1,464	1,628,657	0.3
Shell International Finance BV	0.38%	02/15/2025	1,791	1,995,616	0.4
TotalEnergies Capital International SA	2.13%	03/15/2023	1,854	2,125,651	0.4
				<u>14,726,499</u>	<u>2.8</u>
<b>DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025	USD 1,148	1,259,172	0.2



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Baidu, Inc. ....	2.88%	07/06/2022	USD 1,405	\$ 1,409,464	0.3%
Fidelity National Information Services, Inc. ....	0.75%	05/21/2023	EUR 1,988	2,243,582	0.4
Fiserv, Inc. ....	0.38%	07/01/2023	1,225	1,374,615	0.2
Honeywell International, Inc. ....	0.00%	03/10/2024	1,832	2,041,442	0.4
Oracle Corp. ....	2.50%	04/01/2025	USD 518	516,328	0.1
Oracle Corp. ....	3.13%	07/10/2025	EUR 1,234	1,480,704	0.3
				<u>9,066,135</u>	<u>1.7</u>
				<u>66,834,959</u>	<u>12.8</u>
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
E.ON SE. ....	0.00%	08/28/2024	315	350,722	0.1
EDP Finance BV, Series E. ....	8.63%	01/04/2024	GBP 927	1,393,434	0.2
Electricite de France SA. ....	4.63%	09/11/2024	EUR 1,610	1,988,958	0.4
Enel Finance International NV. ....	0.00%	06/17/2024	549	609,183	0.1
Enel Finance International NV. ....	0.00%	05/28/2026	825	884,864	0.2
Enel Finance International NV. ....	2.65%	09/10/2024	USD 655	658,616	0.1
Engie SA. ....	0.38%	02/28/2023	EUR 2,049	2,303,405	0.4
Scottish Power UK PLC. ....	6.75%	05/29/2023	GBP 1,015	1,444,651	0.3
Western Power Distribution East Midlands PLC. ....	5.25%	01/17/2023	1,475	2,038,993	0.4
				<u>11,672,826</u>	<u>2.2</u>
<b>ERDGAS</b>					
Southern Gas Networks PLC. ....	4.88%	10/05/2023	1,156	1,620,923	0.3
<b>SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
Thames Water Utilities Finance PLC. ....	1.88%	01/24/2024	344	461,300	0.1
				<u>13,755,049</u>	<u>2.6</u>
				<u>149,795,098</u>	<u>28.7</u>
<b>GEDECKTE ANLEIHEN</b>					
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. ....	0.45%	11/22/2023	EUR 2,625	2,966,907	0.6
Bank of Nova Scotia (The) ....	0.01%	03/18/2025	2,312	2,569,677	0.5
BPCE SFH SA. ....	0.13%	03/31/2025	2,342	2,612,199	0.5
CaixaBank SA. ....	2.63%	03/21/2024	488	575,103	0.1
Commonwealth Bank of Australia. ....	0.38%	04/11/2024	1,885	2,125,375	0.4
Credit Agricole Home Loan SFH SA. ....	0.38%	09/30/2024	1,561	1,759,317	0.3
Credit Agricole Home Loan SFH SA. ....	4.00%	07/16/2025	195	245,650	0.0
Danske Mortgage Bank PLC. ....	0.01%	11/24/2026	182	200,239	0.0
DNB Boligkreditt AS. ....	0.63%	06/19/2025	2,030	2,297,516	0.4
Korea Housing Finance Corp. ....	0.10%	06/18/2024	1,859	2,075,076	0.4
National Australia Bank Ltd. ....	0.75%	01/30/2026	1,734	1,963,999	0.4
National Bank of Canada. ....	0.38%	01/15/2024	285	321,660	0.1
National Bank of Canada. ....	0.75%	03/13/2025	609	691,737	0.1
National Westminster Bank PLC. ....	0.50%	05/15/2024	2,710	3,060,632	0.6
Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj. ....	0.63%	05/23/2025	1,789	2,027,316	0.4
Royal Bank of Canada. ....	0.25%	01/29/2024	2,257	2,542,223	0.5
Skandinaviska Enskilda Banken AB. ....	0.38%	02/09/2026	293	327,641	0.1
Societe Generale SFH SA. ....	0.01%	12/02/2026	976	1,070,596	0.2
Stadshypotek AB. ....	0.50%	07/11/2025	2,193	2,473,204	0.5
Sumitomo Mitsui Banking Corp. ....	0.55%	11/06/2023	1,888	2,133,049	0.4
Swedbank Hypotek AB. ....	0.05%	05/28/2025	543	602,847	0.1
Westpac Banking Corp. ....	0.50%	01/16/2025	541	609,344	0.1
Westpac Banking Corp., Series G. ....	0.50%	05/17/2024	2,159	2,439,788	0.5
				<u>37,691,095</u>	<u>7.2</u>
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-3A, Class M1B(a) ....	2.04%	10/25/2028	USD 527	525,433	0.1
Series 2019-3A, Class M1B(a) ....	1.79%	07/25/2029	532	531,318	0.1
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2021-R01, Class 1M1(a) ....	0.80%	10/25/2041	59	58,562	0.0
Series 2021-R01, Class 1M2(a) ....	1.60%	10/25/2041	77	75,059	0.0
Series 2021-R03, Class 1M1(a) ....	0.90%	12/25/2041	712	704,836	0.1
Eagle Re Ltd.					
Series 2021-2, Class M1A(a) ....	1.60%	04/25/2034	146	145,202	0.0
Series 2021-2, Class M1B(a) ....	2.10%	04/25/2034	296	291,363	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2014-DN3, Class M3(a) ....	4.19%	08/25/2024	379	382,990	0.1
Series 2014-HQ2, Class M3(a) ....	3.94%	09/25/2024	640	655,908	0.1
Series 2015-DNA2, Class M3(a) ....	4.09%	12/25/2027	113	113,453	0.0
Series 2021-DNA5, Class M2(a) ....	1.70%	01/25/2034	314	310,549	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 2021-DNA6, Class M1(a) . . . . .	0.85%	10/25/2041	USD 56	\$ 55,018	0.0%
Series 2021-DNA6, Class M2(a) . . . . .	1.55%	10/25/2041	793	764,480	0.1
Series 2021-HQA4, Class M1(a) . . . . .	1.00%	12/25/2041	786	786,043	0.2
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2014-C04, Class 1M2(a) . . . . .	5.09%	11/25/2024	760	786,989	0.2
Series 2014-C04, Class 2M2(a) . . . . .	5.19%	11/25/2024	268	271,394	0.1
Series 2015-C03, Class 2M2(a) . . . . .	5.19%	07/25/2025	6	6,176	0.0
Series 2016-C02, Class 1M2(a) . . . . .	6.19%	09/25/2028	545	564,622	0.1
Series 2016-C03, Class 1M2(a) . . . . .	5.49%	10/25/2028	741	770,827	0.1
Series 2016-C05, Class 2M2(a) . . . . .	4.64%	01/25/2029	765	790,303	0.2
Series 2016-C06, Class 1M2(a) . . . . .	4.44%	04/25/2029	1,293	1,336,126	0.3
Home Re Ltd., Series 2019-1, Class M1(a) . . . . .	1.84%	05/25/2029	673	672,626	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2019-2R, Class A(a) . . . . .	2.86%	05/27/2023	499	495,544	0.1
Radnor Re Ltd., Series 2019-2, Class M1B(a) . . . . .	1.94%	06/25/2029	1,610	1,608,260	0.3
Triangle Re Ltd., Series 2021-3, Class M1A(a) . . . . .	1.95%	02/25/2034	732	725,232	0.1
				<u>13,428,313</u>	<u>2.6</u>
<b>INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE</b>					
<b>AUSTRALIEN</b>					
Australia Government Bond, Series 25CI . . . . .	3.00%	09/20/2025	AUD 4,902	<u>5,304,177</u>	<u>1.0</u>
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
U.S. Treasury Inflation Index . . . . .	0.13%	10/15/2026	USD 4,928	<u>5,296,459</u>	<u>1.0</u>
				<u>10,600,636</u>	<u>2.0</u>
<b>GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN</b>					
<b>KANADA</b>					
Province of British Columbia Canada . . . . .	4.25%	11/27/2024	AUD 4,557	3,517,681	0.7
Province of Ontario Canada, Series HC . . . . .	9.50%	07/13/2022	CAD 2,927	2,384,549	0.4
Province of Ontario Canada, Series HP . . . . .	8.10%	09/08/2023	2,098	1,818,940	0.3
Province of Quebec Canada . . . . .	9.38%	01/16/2023	2,830	<u>2,392,259</u>	<u>0.5</u>
				<u>10,113,429</u>	<u>1.9</u>
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>CLO – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class A1(a) . . . . .	1.41%	07/20/2034	USD 1,606	1,596,512	0.3
AGL CLO Ltd., Series 2021-16A, Class D(a) . . . . .	3.35%	01/20/2035	244	239,260	0.0
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class A1(a) . . . . .	1.30%	10/20/2034	1,116	1,109,584	0.2
Ballyrock CLO Ltd., Series 2021-16A, Class A1(a) . . . . .	1.38%	07/20/2034	1,080	1,071,000	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class A(a) . . . . .	1.34%	07/16/2035	1,399	1,387,604	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 43 Ltd., Series 2021-43A, Class A(a) . . . . .	1.37%	07/17/2035	1,632	1,619,604	0.3
New Mountain CLO Ltd., Series CLO-3A, Class A(a) . . . . .	1.31%	10/20/2034	993	<u>985,135</u>	<u>0.2</u>
				<u>8,008,699</u>	<u>1.5</u>
<b>SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN</b>					
Nordic Investment Bank . . . . .	0.50%	11/03/2025	EUR 2,194	2,481,329	0.5
Nordic Investment Bank . . . . .	4.75%	02/28/2024	AUD 3,234	<u>2,498,387</u>	<u>0.5</u>
				<u>4,979,716</u>	<u>1.0</u>
<b>QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE</b>					
<b>QUASI-STAAATSANLEIHEN</b>					
<b>CHINA</b>					
Export-Import Bank of China (The) . . . . .	0.75%	06/08/2022	EUR 1,771	<u>1,988,012</u>	<u>0.4</u>
<b>SÜDKOREA</b>					
Korea Development Bank (The) . . . . .	0.00%	07/10/2024	492	547,403	0.1
Korea Development Bank (The) . . . . .	1.50%	08/29/2024	AUD 1,952	<u>1,397,750</u>	<u>0.2</u>
				<u>1,945,153</u>	<u>0.3</u>
				<u>3,933,165</u>	<u>0.7</u>
<b>REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN</b>					
<b>JAPAN</b>					
Development Bank of Japan, Inc., Series G . . . . .	0.01%	10/15/2024	EUR 2,425	<u>2,697,105</u>	<u>0.5</u>
<b>REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN</b>					
<b>INDONESIEN</b>					
Indonesia Government International Bond . . . . .	2.15%	07/18/2024	1,327	<u>1,511,494</u>	<u>0.3</u>
<b>PHILIPPINEN</b>					
Philippine Government International Bond . . . . .	0.00%	02/03/2023	1,000	<u>1,115,277</u>	<u>0.2</u>
				<u>2,626,771</u>	<u>0.5</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>					
NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS					
MSCG Trust, Series 2018-SELF, Class A(a)	1.09%	10/15/2037	USD 1,349	\$ 1,337,573	0.3%
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-C8, Class B	3.98%	10/15/2045	1,079	1,081,584	0.2
				2,419,157	0.5
<b>HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN</b>					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal National Mortgage Association, Series 1999	7.00%	09/01/2029	1	576	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 1999	7.00%	10/01/2029	1	1,631	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2000	7.00%	12/01/2030	1	883	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	05/01/2031	0*	256	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	09/01/2031	8	9,455	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	11/01/2031	3	3,522	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	12/01/2031	7	8,110	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	01/01/2032	1	1,633	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2002	7.00%	02/01/2032	2	1,901	0.0
				27,967	0.0
				492,798,604	94.3
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE</b>					
SCHATZPAPIERE					
Spain Government Bond	0.00%	05/31/2024	EUR 8,990	10,093,997	1.9
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
CLO – VARIABLE VERZINSLICH					
Black Diamond CLO Ltd. Series 2019-2A, Class A1A(a)	1.69%	07/23/2032	USD 1,436	1,426,850	0.3
				11,520,847	2.2
<b>Gesamtanlagen</b>					
(Kosten \$532,304,890)				\$ 504,319,451	96.5%
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(b)	(0.21)%	–		53,164	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(b)	0.00 %	–		52,801	0.0
Barclays, London(b)	0.01 %	–		8,954,529	1.7
BBH, Grand Cayman(b)	0.25 %	–		79,738	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	3.00 %	–		1	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.07 %	–		3,324	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.08 %	–		164	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(b)	(0.78)%	–		1,682	0.0
JPMorgan Chase, New York(b)	0.01 %	–		5,523	0.0
SEB, Stockholm(b)	0.10 %	–		108,207	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.78)%	–		259,954	0.1
<b>Termineinlagen insgesamt</b>				9,519,087	1.8
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b>				8,748,092	1.7
<b>Nettovermögen</b>				\$ 522,586,630	100.0%

**TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
<b>Long</b>					
Korea 3 Yr Bond Futures	03/15/2022	84	\$ 7,597,096	\$ 7,537,771	\$ (59,325)
<b>Short</b>					
Euro-BOBL Futures	03/08/2022	283	42,652,633	41,837,447	815,186
Euro-Schatz Futures	03/08/2022	473	59,458,328	59,425,806	32,522
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	06/30/2022	74	8,721,242	8,771,647	(50,405)
					\$ 737,978
				Wertsteigerung	\$ 847,708
				Wertminderung	\$ (109,730)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd. ....	USD 8,398	EUR 7,388	04/14/2022	\$ (99,434)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd. ....	AUD 77,551	USD 54,758	04/28/2022	(1,613,767)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd. ....	USD 2,713	EUR 2,360	05/12/2022	(59,479)
Bank of America, NA. ....	RUB 101,453	USD 1,327	03/02/2022	387,997
Bank of America, NA. ....	USD 1,091	RUB 83,431	03/02/2022	(318,916)
Bank of America, NA. ....	CLP 784,987	USD 979	03/25/2022	(792)
Bank of America, NA. ....	JPY 597,554	USD 5,234	04/14/2022	30,614
Bank of America, NA. ....	USD 5,174	JPY 597,554	04/14/2022	28,612
Bank of America, NA. ....	KRW 4,340,023	USD 3,647	04/28/2022	40,490
Barclays Bank PLC ....	GBP 14,983	USD 20,501	03/17/2022	398,541
Barclays Bank PLC ....	JPY 1,612,136	USD 14,190	03/18/2022	162,478
BNP Paribas SA. ....	USD 2,839	GBP 2,092	03/17/2022	(31,601)
BNP Paribas SA. ....	NZD 2,703	USD 1,795	03/18/2022	(33,488)
BNP Paribas SA. ....	COP 10,301,978	USD 2,609	03/25/2022	(1,176)
BNP Paribas SA. ....	COP 6,497,613	USD 1,658	03/25/2022	11,957
BNP Paribas SA. ....	USD 4,226	COP 16,799,591	03/25/2022	29,964
BNP Paribas SA. ....	JPY 271,269	USD 2,345	04/28/2022	(17,666)
BNP Paribas SA. ....	USD 2,610	TWD 72,402	04/29/2022	(20,724)
BNP Paribas SA. ....	EUR 9,403	USD 10,776	05/17/2022	201,849
BNP Paribas SA. ....	CNH 16,526	USD 2,592	05/18/2022	(10,560)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	GBP 137	USD 184	03/17/2022	(67)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	GBP 1,283	USD 1,728	03/17/2022	6,623
Brown Brothers Harriman & Co. ....	NZD 4,827	USD 3,182	03/18/2022	(83,826)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 5,041	JPY 584,536	03/18/2022	45,272
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 3,088	EUR 2,714	04/14/2022	(39,636)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	AUD 4,875	USD 3,518	04/28/2022	(25,267)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	JPY 768,512	USD 6,757	04/28/2022	63,312
Brown Brothers Harriman & Co. ....	EUR 20,470	USD 23,188	05/12/2022	172,668
Brown Brothers Harriman & Co. ....	USD 1,681	EUR 1,467	05/12/2022	(31,673)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	JPY 627,059	USD 5,458	05/16/2022	(5,585)
Brown Brothers Harriman & Co.+ ....	AUD 289	USD 208	03/18/2022	(2,118)
Brown Brothers Harriman & Co.+ ....	CAD 147	USD 116	03/18/2022	(254)
Brown Brothers Harriman & Co.+ ....	EUR 40	USD 45	03/18/2022	(55)
Brown Brothers Harriman & Co.+ ....	EUR 129	USD 145	03/18/2022	1,127
Brown Brothers Harriman & Co.+ ....	GBP 191	USD 260	03/18/2022	3,183
Brown Brothers Harriman & Co.+ ....	NZD 19	USD 12	03/18/2022	(212)
Brown Brothers Harriman & Co.+ ....	USD 13,385	AUD 18,651	03/18/2022	165,342
Brown Brothers Harriman & Co.+ ....	USD 7,367	CAD 9,352	03/18/2022	11,939
Brown Brothers Harriman & Co.+ ....	USD 7,915	EUR 6,963	03/18/2022	(102,122)
Brown Brothers Harriman & Co.+ ....	USD 8,108	GBP 5,973	03/18/2022	(93,941)
Brown Brothers Harriman & Co.+ ....	USD 567	NZD 852	03/18/2022	9,242
Brown Brothers Harriman & Co.+ ....	USD 907	SGD 1,219	03/18/2022	(8,016)
Citibank, NA ....	RUB 407,646	USD 5,460	03/02/2022	1,685,445
Citibank, NA ....	USD 1,313	RUB 101,971	03/02/2022	(369,185)
Citibank, NA ....	CLP 2,174,600	USD 2,638	03/25/2022	(75,262)
Citibank, NA ....	USD 2,709	CLP 2,174,600	03/25/2022	4,322
Citibank, NA ....	INR 194,339	USD 2,566	04/07/2022	2,866
Citibank, NA ....	USD 2,552	INR 192,692	04/07/2022	(10,498)
Citibank, NA ....	CHF 2,409	USD 2,622	04/13/2022	(9,986)
Citibank, NA ....	CAD 6,643	USD 5,205	04/22/2022	(36,481)
Citibank, NA ....	USD 2,620	CAD 3,323	04/22/2022	2,799
Credit Suisse International. ....	NOK 22,752	USD 2,570	03/24/2022	(10,620)
Credit Suisse International. ....	USD 2,553	NOK 22,752	03/24/2022	27,410
Credit Suisse International. ....	CHF 2,414	USD 2,610	04/13/2022	(26,856)
Credit Suisse International. ....	USD 2,605	CHF 2,414	04/13/2022	32,116
Goldman Sachs Bank USA ....	MXN 53,186	USD 2,588	03/24/2022	1,886
Goldman Sachs Bank USA ....	SEK 24,373	USD 2,586	03/24/2022	10,982
Goldman Sachs Bank USA ....	USD 2,592	MXN 53,186	03/24/2022	(5,077)
Goldman Sachs Bank USA ....	USD 2,632	SEK 24,373	03/24/2022	(57,246)
HSBC Bank USA. ....	USD 2,554	SEK 23,265	03/24/2022	(96,518)
HSBC Bank USA. ....	CLP 2,185,464	USD 2,720	03/25/2022	(6,546)
HSBC Bank USA. ....	CLP 2,076,056	USD 2,603	03/25/2022	12,929
HSBC Bank USA. ....	COP 10,222,158	USD 2,565	03/25/2022	(24,773)
HSBC Bank USA. ....	JPY 903,904	USD 7,897	03/25/2022	30,128
HSBC Bank USA. ....	USD 5,288	CLP 4,261,520	03/25/2022	28,615
HSBC Bank USA. ....	USD 1,641	COP 6,452,105	03/25/2022	(6,638)
HSBC Bank USA. ....	USD 955	COP 3,770,053	03/25/2022	275
HSBC Bank USA. ....	USD 7,823	JPY 903,904	03/25/2022	43,445
HSBC Bank USA. ....	EUR 32,952	USD 37,238	03/28/2022	247,249
HSBC Bank USA. ....	USD 5,212	SGD 7,022	04/21/2022	(33,471)
HSBC Bank USA. ....	KRW 3,135,462	USD 2,617	04/28/2022	11,188

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
HSBC Bank USA	USD 2,574	IDR 37,109,086	04/28/2022	\$ (3,556)
HSBC Bank USA	USD 2,569	IDR 37,207,902	04/28/2022	8,133
HSBC Bank USA	USD 2,610	KRW 3,135,461	04/28/2022	(4,013)
HSBC Bank USA	EUR 33,451	USD 38,258	04/29/2022	666,655
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR 29,392	USD 33,673	03/17/2022	696,289
JPMorgan Chase Bank, NA	NZD 5,245	USD 3,477	03/18/2022	(70,791)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 2,629	NZD 4,013	03/18/2022	85,719
JPMorgan Chase Bank, NA	MXN 51,966	USD 2,504	03/24/2022	(23,320)
JPMorgan Chase Bank, NA	MXN 1,419	USD 69	03/24/2022	134
JPMorgan Chase Bank, NA	NOK 22,790	USD 2,588	03/24/2022	3,405
JPMorgan Chase Bank, NA	SEK 23,247	USD 2,551	03/24/2022	94,984
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 2,617	MXN 53,386	03/24/2022	(20,817)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 2,574	NOK 22,790	03/24/2022	10,385
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 2,467	SEK 23,247	03/24/2022	(10,603)
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR 47,724	USD 53,898	04/14/2022	291,650
JPMorgan Chase Bank, NA	SGD 3,455	USD 2,551	04/21/2022	3,148
Morgan Stanley & Co., Inc.	USD 1,132	EUR 991	03/17/2022	(20,307)
Morgan Stanley & Co., Inc.	NZD 25,305	USD 17,120	03/18/2022	2,014
Morgan Stanley & Co., Inc.	MXN 52,422	USD 2,554	03/24/2022	4,545
Morgan Stanley & Co., Inc.	USD 2,542	MXN 52,422	03/24/2022	7,311
Morgan Stanley & Co., Inc.	EUR 2,901	USD 3,287	03/28/2022	30,907
Morgan Stanley & Co., Inc.	CAD 29,684	USD 23,346	04/22/2022	(76,749)
Morgan Stanley & Co., Inc.	JPY 612,086	USD 5,331	04/28/2022	448
Morgan Stanley & Co., Inc.	USD 5,302	JPY 612,086	04/28/2022	29,210
Morgan Stanley & Co., Inc.	USD 2,607	KRW 3,129,194	04/28/2022	(6,588)
Morgan Stanley & Co., Inc.	PLN 10,779	USD 2,704	05/06/2022	148,629
Morgan Stanley & Co., Inc.	EUR 3,687	USD 4,195	05/31/2022	46,335
Standard Chartered Bank	IDR 36,931,312	USD 2,560	04/28/2022	1,764
Standard Chartered Bank	TWD 72,123	USD 2,584	04/29/2022	4,693
UBS AG	RUB 276,933	USD 3,572	03/02/2022	1,007,981
UBS AG	USD 7,502	RUB 600,630	03/02/2022	(1,940,498)
UBS AG	RUB 398,422	USD 4,749	03/24/2022	1,060,397
UBS AG	USD 2,553	MXN 52,395	03/24/2022	(5,363)
UBS AG	USD 4,473	RUB 371,489	03/24/2022	(1,034,032)
UBS AG	CHF 2,414	USD 2,605	04/13/2022	(32,259)
UBS AG	CHF 2,347	USD 2,568	04/13/2022	3,740
UBS AG	USD 5,171	CHF 4,761	04/13/2022	31,073
UBS AG	JPY 2,103,960	USD 18,222	04/28/2022	(101,822)
UBS AG	USD 18,211	JPY 2,103,960	04/28/2022	112,957
				\$ 1,545,122
			Wertsteigerung	\$ 8,265,371
			Wertminderung	\$ (6,720,250)

+ 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)	NZD 5,136	11/01/2024	3 Month BKBM	2.580%	\$ (25,249)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	13,736	11/02/2024	3 Month BKBM	2.503%	(86,736)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	12,636	11/10/2024	3 Month BKBM	2.448%	(92,648)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	CNY 43,910	05/07/2025	Reverse Repo Rate China 7-Day	1.830%	(107,018)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	75,311	07/21/2025	Reverse Repo Rate China 7-Day	2.585%	92,183
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	41,900	07/22/2025	Reverse Repo Rate China 7-Day	2.510%	34,819
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	42,485	09/01/2025	Reverse Repo Rate	2.748%	88,436
Insgesamt					\$ (96,213)
				Wertsteigerung	\$ 215,438
				Wertminderung	\$ (311,651)

\* Kapitalbetrag geringer als 500.

(a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2022.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	–	Australian Dollar
CAD	–	Canadian Dollar
CHF	–	Swiss Franc
CLP	–	Chilean Peso
CNH	–	Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
CNY	–	Chinese Yuan Renminbi
COP	–	Colombian Peso
EUR	–	Euro
GBP	–	Great British Pound
IDR	–	Indonesian Rupiah
INR	–	Indian Rupee
JPY	–	Japanese Yen
KRW	–	South Korean Won
MXN	–	Mexican Peso
NOK	–	Norwegian Krone
NZD	–	New Zealand Dollar
PLN	–	Polish Zloty
RUB	–	Russian Ruble
SEK	–	Swedish Krona
SGD	–	Singapore Dollar
TWD	–	New Taiwan Dollar
USD	–	United States Dollar

Glossar:

BKBM	–	Bank Bill Bench Market rate
BOBL	–	Bundesobligationen
CBT	–	Chicago Board of Trade
CLO	–	Collateralized Loan Obligations
CMBS	–	Commercial Mortgage-Backed Securities
LCH	–	London Clearing House
REIT	–	Real Estate Investment Trust

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>					
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Advanced Drainage Systems, Inc.	5.00%	09/30/2027	USD 2,804	\$ 2,820,313	0.0%
ASP Unifrax Holdings, Inc.	5.25%	09/30/2028	3,109	2,992,308	0.0
ASP Unifrax Holdings, Inc.	7.50%	09/30/2029	4,318	3,941,024	0.0
Avient Corp.	5.75%	05/15/2025	7,156	7,333,703	0.1
Axalta Coating Systems LLC	3.38%	02/15/2029	3,163	2,903,041	0.0
Big River Steel LLC/BRS Finance Corp.	6.63%	01/31/2029	20,800	21,803,548	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	4.63%	03/01/2029	8,053	7,788,433	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	4.88%	03/01/2031	8,434	8,227,249	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026	2,020	2,128,253	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	9.88%	10/17/2025	14,805	16,486,787	0.1
CVR Partners LP/CVR Nitrogen Finance Corp.	6.13%	06/15/2028	14,545	14,592,266	0.1
Diamond BC BV	4.63%	10/01/2029	10,161	9,210,053	0.1
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.38%	04/01/2031	1,000	964,402	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	3,648	3,646,031	0.0
Glatfelter Corp.	4.75%	11/15/2029	11,574	11,030,266	0.1
Graham Packaging Co., Inc.	7.13%	08/15/2028	6,383	6,143,675	0.0
Hecla Mining Co.	7.25%	02/15/2028	25,670	26,953,738	0.2
Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV, Inc.	9.00%	07/01/2028	19,086	20,119,750	0.1
Ingevity Corp.	3.88%	11/01/2028	1,000	941,526	0.0
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./ Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	29,516	28,731,118	0.2
Joseph T Ryerson & Son, Inc.	8.50%	08/01/2028	7,758	8,393,431	0.1
Mercer International, Inc.	5.13%	02/01/2029	20,091	19,657,515	0.1
Olin Corp.	5.00%	02/01/2030	1,000	1,012,516	0.0
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	19,555	20,385,784	0.1
PIC AU Holdings LLC/PIC AU Holdings Corp.	10.00%	12/31/2024	1,871	1,927,130	0.0
PMHC II, Inc.	9.00%	02/15/2030	55,708	54,111,498	0.3
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	4.38%	11/01/2026	EUR 5,856	6,396,539	0.0
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	5.38%	11/01/2026	USD 21,559	21,535,567	0.1
Valvoline, Inc.	3.63%	06/15/2031	1,000	898,896	0.0
Valvoline, Inc.	4.25%	02/15/2030	25,506	24,177,050	0.1
WR Grace Holdings LLC	4.88%	06/15/2027	21,036	20,949,597	0.1
				<u>378,203,007</u>	<u>2.2</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
ARD Finance SA(a)	5.00%	06/30/2027	EUR 14,174	15,159,671	0.1
ARD Finance SA(a)	6.50%	06/30/2027	USD 15,519	14,887,514	0.1
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC	4.00%	09/01/2029	1,000	937,800	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	4.13%	08/15/2026	1,000	969,979	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	08/15/2027	1,000	928,350	0.0
Bombardier, Inc.	7.50%	12/01/2024	16,280	16,860,003	0.1
Bombardier, Inc.	7.50%	03/15/2025	37,769	38,161,741	0.2
Bombardier, Inc.	7.88%	04/15/2027	541	548,460	0.0
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	2,611	2,668,780	0.0
Cleaver-Brooks, Inc.	7.88%	03/01/2023	13,689	13,213,041	0.1
Colfax Corp.	6.38%	02/15/2026	705	726,556	0.0
Eco Material Technologies, Inc.	7.88%	01/31/2027	22,209	22,469,478	0.1
EnerSys	4.38%	12/15/2027	18,085	17,904,985	0.1
F-Brasile SpA/F-Brasile US LLC, Series XR	7.38%	08/15/2026	20,200	19,527,355	0.1
Gates Global LLC/Gates Corp.	6.25%	01/15/2026	25,892	26,476,641	0.2
GFL Environmental, Inc.	3.50%	09/01/2028	1,000	955,571	0.0
GFL Environmental, Inc.	4.75%	06/15/2029	18,492	17,650,981	0.1
Granite US Holdings Corp.	11.00%	10/01/2027	27,965	29,872,820	0.2
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	28,956	28,821,472	0.2
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	2,036	1,998,577	0.0
Madison IAQ LLC	5.88%	06/30/2029	41,603	37,736,581	0.2
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	7,075	6,954,444	0.0
Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025	EUR 8,798	9,915,555	0.1
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp.	5.25%	01/15/2029	USD 3,336	3,354,850	0.0
Tervita Corp.	11.00%	12/01/2025	16,302	18,749,892	0.1
TK Elevator Holdco GmbH	7.63%	07/15/2028	7,893	8,032,027	0.0
TK Elevator US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	15,684	15,635,274	0.1
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024	7,229	7,187,191	0.0
Triumph Group, Inc.	7.75%	08/15/2025	8,167	8,210,552	0.1
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024	13,567	14,479,194	0.1
Trivium Packaging Finance BV	3.75%	08/15/2026	EUR 1,566	1,679,376	0.0
Wesco Distribution, Inc.	7.13%	06/15/2025	USD 31,560	33,031,574	0.2
Wesco Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	10,669	11,456,984	0.1
				<u>447,163,269</u>	<u>2.6</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	USD 36,810	\$ 37,089,112	0.2%
Altice Financing SA	5.75%	08/15/2029	73,220	66,665,335	0.4
Arches Buyer, Inc.	6.13%	12/01/2028	8,568	8,025,980	0.1
Banjay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025	6,056	6,015,086	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.25%	01/15/2034	22,642	20,812,179	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	21,000	20,235,035	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.75%	02/01/2032	17,214	16,734,584	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.00%	02/01/2028	1,000	1,006,073	0.0
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	21,181	21,154,154	0.1
CSC Holdings LLC	5.00%	11/15/2031	18,328	15,272,407	0.1
CSC Holdings LLC	5.38%	02/01/2028	1,000	972,745	0.0
CSC Holdings LLC	5.50%	04/15/2027	6,197	6,207,764	0.0
CSC Holdings LLC	5.75%	01/15/2030	24,512	21,687,290	0.1
CSC Holdings LLC	6.50%	02/01/2029	1,000	1,012,259	0.0
CSC Holdings LLC	7.50%	04/01/2028	17,996	17,974,205	0.1
DISH DBS Corp.	5.00%	03/15/2023	36,424	36,808,763	0.2
DISH DBS Corp.	5.25%	12/01/2026	27,259	26,589,133	0.2
DISH DBS Corp.	5.75%	12/01/2028	30,009	28,733,816	0.2
DISH DBS Corp.	5.88%	11/15/2024	4,019	4,019,633	0.0
Gray Escrow II, Inc.	5.38%	11/15/2031	31,385	30,211,206	0.2
Gray Television, Inc.	5.88%	07/15/2026	2,000	2,044,828	0.0
Gray Television, Inc.	7.00%	05/15/2027	1,000	1,051,340	0.0
iHeartCommunications, Inc.	4.75%	01/15/2028	6,435	6,224,037	0.1
iHeartCommunications, Inc.	5.25%	08/15/2027	5,448	5,428,953	0.0
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026	2,630	2,711,845	0.0
iHeartCommunications, Inc.	8.38%	05/01/2027	4,768	4,965,737	0.0
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029	2,301	2,311,146	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	20,019	20,546,845	0.1
Liberty Interactive LLC(b)	3.75%	02/15/2030	11,923	8,530,509	0.1
Liberty Interactive LLC	8.25%	02/01/2030	3,000	2,947,507	0.0
McGraw-Hill Education, Inc.	5.75%	08/01/2028	38,388	36,404,300	0.2
McGraw-Hill Education, Inc.	8.00%	08/01/2029	20,010	17,958,975	0.1
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026	6,800	4,895,734	0.0
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028	12,566	11,126,296	0.1
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp.	4.63%	03/15/2030	10,335	9,808,976	0.1
Scripps Escrow II, Inc.	3.88%	01/15/2029	1,000	939,342	0.0
Scripps Escrow II, Inc.	5.38%	01/15/2031	9,519	9,050,045	0.1
Scripps Escrow, Inc.	5.88%	07/15/2027	12,381	12,379,429	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	23,135	20,434,553	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.88%	03/15/2026	895	888,472	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	4.00%	07/15/2028	58,351	56,089,899	0.3
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029	1,000	1,022,555	0.0
Summer BC Bidco B LLC	5.50%	10/31/2026	6,800	6,559,697	0.1
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	EUR 19,048	21,505,296	0.1
TEGNA, Inc.	4.75%	03/15/2026	USD 4,806	4,836,548	0.0
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029	18,735	18,736,631	0.1
Univision Communications, Inc.	4.50%	05/01/2029	5,371	5,108,189	0.0
Univision Communications, Inc.	5.13%	02/15/2025	1,681	1,693,100	0.0
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	29,088	30,346,080	0.2
Univision Communications, Inc.	9.50%	05/01/2025	13,167	13,873,464	0.1
UPC Holding BV	5.50%	01/15/2028	52,055	51,048,585	0.3
Urban One, Inc.	7.38%	02/01/2028	49,053	49,209,009	0.3
Virgin Media Secured Finance PLC	4.50%	08/15/2030	4,000	3,775,196	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	5.00%	04/15/2027	GBP 2,000	2,702,235	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	05/15/2029	USD 1,952	1,938,200	0.0
Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC	5.00%	07/15/2028	2,300	2,179,250	0.0
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	4,484	4,178,845	0.0
Ziggo Bond Co. BV	6.00%	01/15/2027	2,820	2,852,758	0.0
				<u>845,531,165</u>	<u>4.8</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
Altice France SA/France	8.13%	02/01/2027	8,421	8,880,061	0.1
Arqiva Broadcast Finance PLC	6.75%	09/30/2023	GBP 6,698	9,007,260	0.1
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026	USD 40,626	41,133,825	0.2
Consolidated Communications, Inc.	5.00%	10/01/2028	5,735	5,454,786	0.0
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	24,110	24,058,421	0.1
DKT Finance ApS	7.00%	06/17/2023	EUR 8,954	10,045,293	0.1
DKT Finance ApS	9.38%	06/17/2023	USD 23,497	23,540,959	0.1
Embarq Corp.	8.00%	06/01/2036	32,601	32,409,325	0.2
Frontier Communications Holdings LLC	5.88%	10/15/2027	16,401	16,624,578	0.1
Frontier Communications Holdings LLC	6.75%	05/01/2029	12,000	11,655,858	0.1
Hughes Satellite Systems Corp.	6.63%	08/01/2026	13,000	13,543,865	0.1
Iliad Holding SASU	6.50%	10/15/2026	11,478	11,470,376	0.1



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Iliad Holding SASU . . . . .	7.00%	10/15/2028	USD 8,644	\$ 8,600,137	0.0%
Intelsat Jackson Holdings SA(c) . . . . .	5.50%	08/01/2023	33,777	14,443,277	0.1
Kaixo Bondco Telecom SA . . . . .	5.13%	09/30/2029	EUR 18,989	19,781,019	0.1
Level 3 Financing, Inc. . . . .	4.25%	07/01/2028	USD 7,061	6,525,266	0.0
Level 3 Financing, Inc. . . . .	4.63%	09/15/2027	10,761	10,382,722	0.1
Lumen Technologies, Inc. . . . .	5.63%	04/01/2025	1,000	995,247	0.0
Lumen Technologies, Inc., Series T . . . . .	5.80%	03/15/2022	1,492	1,492,841	0.0
Lumen Technologies, Inc., Series P . . . . .	7.60%	09/15/2039	1,567	1,379,127	0.0
Nexstar Media, Inc. . . . .	5.63%	07/15/2027	11,783	12,047,392	0.1
Sprint Capital Corp. . . . .	8.75%	03/15/2032	455	631,053	0.0
Sprint Corp. . . . .	7.13%	06/15/2024	1,000	1,083,292	0.0
Sprint Corp. . . . .	7.63%	02/15/2025	3,000	3,324,692	0.0
Sprint Corp. . . . .	7.63%	03/01/2026	8,328	9,497,573	0.1
Sprint Corp. . . . .	7.88%	09/15/2023	25,000	26,866,471	0.1
Telecom Italia Capital SA . . . . .	6.00%	09/30/2034	2,000	1,901,440	0.0
Telecom Italia Capital SA . . . . .	7.20%	07/18/2036	31,658	32,122,354	0.1
Telecom Italia Capital SA . . . . .	7.72%	06/04/2038	13,001	13,419,703	0.1
Vmed O2 UK Financing I PLC . . . . .	4.75%	07/15/2031	42,248	40,021,965	0.2
Zayo Group Holdings, Inc. . . . .	6.13%	03/01/2028	17,177	15,951,196	0.1
				428,291,374	2.4
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
Allison Transmission, Inc. . . . .	5.88%	06/01/2029	7,094	7,450,139	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc. . . . .	6.25%	03/15/2026	4,000	4,053,779	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc. . . . .	6.50%	04/01/2027	1,890	1,932,486	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc. . . . .	6.88%	07/01/2028	15,455	15,918,650	0.1
Aston Martin Capital Holdings Ltd. . . . .	10.50%	11/30/2025	33,751	35,349,496	0.2
Aston Martin Capital Holdings Ltd.(a) . . . . .	15.00%	11/30/2026	28,658	31,555,783	0.2
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co. . . . .	4.38%	05/15/2026	EUR 3,111	3,428,508	0.0
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co. . . . .	6.25%	05/15/2026	USD 5,621	5,812,339	0.0
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co. . . . .	8.50%	05/15/2027	37,834	39,490,886	0.2
Dana, Inc. . . . .	5.38%	11/15/2027	232	236,640	0.0
Dana, Inc. . . . .	5.63%	06/15/2028	3,358	3,444,476	0.0
Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC . . . . .	8.00%	02/01/2028	34,435	34,461,312	0.2
Ford Motor Credit Co. LLC . . . . .	4.38%	08/06/2023	500	507,374	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The) . . . . .	5.00%	07/15/2029	6,459	6,366,931	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The) . . . . .	5.25%	07/15/2031	5,865	5,707,369	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(a) . . . . .	3.75%	09/15/2026	EUR 1,111	1,229,946	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(a) . . . . .	6.00%	05/15/2027	USD 15,335	15,684,334	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a) . . . . .	6.38%	05/15/2029	15,335	15,954,003	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC . . . . .	2.20%	01/15/2024	EUR 3,000	3,272,050	0.0
Jaguar Land Rover Automotive PLC . . . . .	5.50%	07/15/2029	USD 10,597	10,060,548	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC . . . . .	5.88%	11/15/2024	EUR 8,244	9,543,768	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC . . . . .	5.88%	01/15/2028	USD 28,297	27,791,036	0.2
Jaguar Land Rover Automotive PLC . . . . .	7.75%	10/15/2025	24,649	25,971,105	0.2
McLaren Finance PLC . . . . .	7.50%	08/01/2026	40,320	40,092,829	0.2
Meritor, Inc. . . . .	6.25%	06/01/2025	7,776	8,083,522	0.1
PM General Purchaser LLC . . . . .	9.50%	10/01/2028	28,314	27,019,807	0.2
Tenneco, Inc. . . . .	5.00%	07/15/2026	31,522	31,470,895	0.2
Tenneco, Inc. . . . .	5.13%	04/15/2029	3,375	3,379,775	0.0
Tenneco, Inc. . . . .	7.88%	01/15/2029	6,003	6,341,497	0.0
Titan International, Inc. . . . .	7.00%	04/30/2028	24,723	25,569,270	0.1
ZF North America Capital, Inc. . . . .	4.75%	04/29/2025	26,379	26,883,391	0.2
				474,063,944	2.7
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG</b>					
Carnival Corp. . . . .	4.00%	08/01/2028	15,210	14,506,538	0.1
Carnival Corp. . . . .	5.75%	03/01/2027	29,310	28,476,130	0.2
Carnival Corp. . . . .	9.88%	08/01/2027	13,439	15,102,076	0.1
Carnival Corp. . . . .	10.13%	02/01/2026	EUR 12,307	15,248,142	0.1
Carnival Corp. . . . .	10.50%	02/01/2026	USD 1,000	1,123,750	0.0
Cedar Fair LP . . . . .	5.25%	07/15/2029	2,000	1,998,479	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op. . . . .	5.50%	05/01/2025	41,998	43,164,120	0.2
Lindblad Expeditions LLC . . . . .	6.75%	02/15/2027	9,468	9,558,033	0.1
Mattel, Inc. . . . .	5.88%	12/15/2027	3,598	3,812,588	0.0
Motion Bondco DAC . . . . .	4.50%	11/15/2027	EUR 13,300	13,791,203	0.1
NCL Corp., Ltd. . . . .	5.88%	03/15/2026	USD 29,640	28,526,921	0.2
Royal Caribbean Cruises Ltd. . . . .	5.38%	07/15/2027	16,520	16,189,600	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd. . . . .	5.50%	04/01/2028	13,254	12,955,785	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd. . . . .	10.88%	06/01/2023	25,951	27,788,071	0.1
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc. . . . .	8.75%	05/01/2025	19,206	20,203,516	0.1
Six Flags Theme Parks, Inc. . . . .	7.00%	07/01/2025	8,239	8,609,959	0.0
Vail Resorts, Inc. . . . .	6.25%	05/15/2025	6,640	6,890,887	0.0
Viking Cruises Ltd. . . . .	5.88%	09/15/2027	29,535	27,424,043	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Viking Cruises Ltd. ....	7.00%	02/15/2029	USD 11,973	\$ 11,318,599	0.1%
Viking Cruises Ltd. ....	13.00%	05/15/2025	12,492	13,905,495	0.1
				<u>320,593,935</u>	<u>1.8</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Adams Homes, Inc. ....	7.50%	02/15/2025	16,531	16,803,019	0.1
Beazer Homes USA, Inc. ....	6.75%	03/15/2025	21,605	21,899,454	0.1
Boyd Gaming Corp. ....	8.63%	06/01/2025	4,195	4,423,687	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC ....	4.88%	02/15/2030	26,127	23,917,848	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC ....	6.25%	09/15/2027	19,888	20,017,491	0.1
Caesars Entertainment, Inc. ....	6.25%	07/01/2025	22,343	23,167,183	0.1
Churchill Downs, Inc. ....	5.50%	04/01/2027	2,000	2,027,458	0.0
CP Atlas Buyer, Inc. ....	7.00%	12/01/2028	14,319	12,900,319	0.1
Empire Communities Corp. ....	7.00%	12/15/2025	6,172	6,119,790	0.0
Everi Holdings, Inc. ....	5.00%	07/15/2029	3,865	3,789,181	0.0
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp. ....	7.88%	11/15/2025	32,611	33,375,269	0.2
Forterra Finance LLC/FRTA Finance Corp. ....	6.50%	07/15/2025	5,954	6,181,784	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc. ....	5.38%	05/01/2025	5,320	5,483,493	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc. ....	5.75%	05/01/2028	5,733	5,991,277	0.0
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc ....	4.88%	07/01/2031	16,956	16,171,769	0.1
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc ....	5.00%	06/01/2029	14,836	14,637,388	0.1
Installed Building Products, Inc. ....	5.75%	02/01/2028	5,705	5,695,303	0.0
International Game Technology PLC ....	5.25%	01/15/2029	512	517,726	0.0
International Game Technology PLC ....	6.25%	01/15/2027	9,125	9,746,671	0.1
International Game Technology PLC ....	6.50%	02/15/2025	23,261	24,585,736	0.1
KB Home ....	4.80%	11/15/2029	5,544	5,545,472	0.0
KB Home ....	7.50%	09/15/2022	7,596	7,811,260	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc. ....	4.50%	06/15/2029	9,893	9,439,379	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc. ....	6.13%	09/15/2025	6,973	7,208,703	0.1
Mattamy Group Corp. ....	4.63%	03/01/2030	28,097	26,408,286	0.2
MGM Resorts International ....	7.75%	03/15/2022	2,370	2,375,925	0.0
Premier Entertainment Sub LLC/ Premier Entertainment Finance Corp. ....	5.63%	09/01/2029	20,595	18,710,927	0.1
Premier Entertainment Sub LLC/ Premier Entertainment Finance Corp. ....	5.88%	09/01/2031	20,595	18,689,963	0.1
Scientific Games International, Inc. ....	3.38%	02/15/2026	EUR 1,111	1,236,515	0.0
Scientific Games International, Inc. ....	5.00%	10/15/2025	USD 6,488	6,563,660	0.0
Scientific Games International, Inc. ....	7.00%	05/15/2028	7,525	7,808,363	0.1
Scientific Games International, Inc. ....	8.25%	03/15/2026	11,000	11,488,786	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp. ....	4.75%	02/15/2028	10,577	10,179,713	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp. ....	4.75%	04/01/2029	14,461	13,751,633	0.1
Standard Industries, Inc./NJ. ....	4.38%	07/15/2030	1,000	944,248	0.0
Standard Industries, Inc./NJ. ....	5.00%	02/15/2027	1,000	1,006,787	0.0
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP/ Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp. ....	5.88%	05/15/2025	22,618	22,399,935	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc. ....	5.75%	01/15/2028	14,127	14,666,834	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc. ....	5.88%	06/15/2027	11,351	11,913,419	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc./ Taylor Morrison Holdings II, Inc. ....	5.88%	04/15/2023	15,712	16,006,600	0.1
Travel + Leisure Co. ....	4.50%	12/01/2029	16,710	16,037,465	0.1
Travel + Leisure Co. ....	4.63%	03/01/2030	15,276	14,543,222	0.1
Travel + Leisure Co. ....	6.00%	04/01/2027	4,000	4,173,093	0.0
Travel + Leisure Co. ....	6.63%	07/31/2026	29,164	31,216,175	0.2
Victors Merger Corp. ....	6.38%	05/15/2029	38,070	32,981,170	0.2
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp. ....	4.25%	05/30/2023	1,667	1,672,633	0.0
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp. ....	5.25%	05/15/2027	3,000	2,983,148	0.0
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp. ....	5.50%	03/01/2025	14,263	14,368,432	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp. ....	5.13%	10/01/2029	6,690	6,490,992	0.0
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp. ....	7.75%	04/15/2025	9,543	9,972,595	0.1
				<u>606,047,179</u>	<u>3.5</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS</b>					
IRB Holding Corp. ....	6.75%	02/15/2026	43,629	43,891,039	0.2
IRB Holding Corp. ....	7.00%	06/15/2025	10,678	11,163,541	0.1
Papa John's International, Inc. ....	3.88%	09/15/2029	5,437	5,065,968	0.0
Yum! Brands, Inc. ....	7.75%	04/01/2025	8,625	8,990,169	0.1
				<u>69,110,717</u>	<u>0.4</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
Arko Corp. ....	5.13%	11/15/2029	USD 18,547	\$ 17,131,747	0.1%
Asbury Automotive Group, Inc. ....	4.63%	11/15/2029	16,345	15,943,023	0.1
Asbury Automotive Group, Inc. ....	5.00%	02/15/2032	7,235	7,058,553	0.1
Bath & Body Works, Inc. ....	5.25%	02/01/2028	3,551	3,698,216	0.0
Bath & Body Works, Inc. ....	6.63%	10/01/2030	5,689	6,143,285	0.0
Bath & Body Works, Inc. ....	6.75%	07/01/2036	11,880	12,947,110	0.1
Bath & Body Works, Inc. ....	6.88%	11/01/2035	13,781	15,235,899	0.1
Bath & Body Works, Inc. ....	6.95%	03/01/2033	13,864	14,649,659	0.1
Bath & Body Works, Inc. ....	7.50%	06/15/2029	5,283	5,788,788	0.0
Bath & Body Works, Inc. ....	7.60%	07/15/2037	4,421	4,826,149	0.0
Bath & Body Works, Inc. ....	9.38%	07/01/2025	1,656	1,937,622	0.0
BCPE Ulysses Intermediate, Inc.(a) ....	7.75%	04/01/2027	19,207	17,972,538	0.1
Dufry One BV ....	2.50%	10/15/2024	EUR 17,530	19,063,875	0.1
FirstCash, Inc. ....	4.63%	09/01/2028	USD 1,000	943,665	0.0
FirstCash, Inc. ....	5.63%	01/01/2030	21,145	20,900,921	0.1
Foundation Building Materials, Inc. ....	6.00%	03/01/2029	5,396	5,036,467	0.0
Gap, Inc. (The) ....	3.63%	10/01/2029	5,357	4,857,626	0.0
Gap, Inc. (The) ....	3.88%	10/01/2031	4,852	4,353,791	0.0
Kontoor Brands, Inc. ....	4.13%	11/15/2029	23,553	22,290,971	0.1
LBM Acquisition LLC ....	6.25%	01/15/2029	7,137	6,609,487	0.1
Michaels Cos, Inc. (The) ....	7.88%	05/01/2029	55,224	48,004,988	0.3
Murphy Oil USA, Inc. ....	3.75%	02/15/2031	1,000	931,862	0.0
Murphy Oil USA, Inc. ....	5.63%	05/01/2027	1,441	1,479,877	0.0
NMG Holding Co., Inc./Neiman Marcus Group LLC ....	7.13%	04/01/2026	14,261	14,679,586	0.1
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp. ....	4.75%	02/15/2028	6,641	6,622,099	0.1
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp. ....	7.75%	02/15/2029	38,041	39,981,982	0.2
Rite Aid Corp. ....	7.50%	07/01/2025	22,144	21,253,137	0.1
Rite Aid Corp. ....	8.00%	11/15/2026	21,400	20,385,051	0.1
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp. ....	6.38%	09/30/2026	19,813	19,956,014	0.1
SRS Distribution, Inc. ....	6.13%	07/01/2029	6,009	5,724,598	0.0
Staples, Inc. ....	7.50%	04/15/2026	656	647,959	0.0
Staples, Inc. ....	10.75%	04/15/2027	43,095	40,224,630	0.2
TPro Acquisition Corp. ....	11.00%	10/15/2024	16,176	17,405,867	0.1
White Cap Buyer LLC ....	6.88%	10/15/2028	29,658	29,519,557	0.2
White Cap Parent LLC(a) ....	8.25%	03/15/2026	7,186	7,239,463	0.1
William Carter Co. (The) ....	5.50%	05/15/2025	15,769	16,252,479	0.1
				<u>497,698,541</u>	<u>2.8</u>
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
AdaptHealth LLC ....	4.63%	08/01/2029	1,000	902,545	0.0
AdaptHealth LLC ....	5.13%	03/01/2030	24,648	22,914,474	0.1
AdaptHealth LLC ....	6.13%	08/01/2028	5,430	5,413,644	0.0
AHP Health Partners, Inc. ....	5.75%	07/15/2029	20,045	18,915,927	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC ....	4.63%	01/15/2027	12,062	12,125,058	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC ....	4.88%	02/15/2030	7,984	8,001,957	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC ....	5.88%	02/15/2028	1,000	1,038,660	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC ....	7.50%	03/15/2026	5,667	6,005,792	0.0
Bausch Health Americas, Inc. ....	8.50%	01/31/2027	15,514	15,709,780	0.1
Bausch Health Americas, Inc. ....	9.25%	04/01/2026	5,000	5,173,455	0.0
Bausch Health Cos., Inc. ....	5.75%	08/15/2027	3,475	3,476,443	0.0
Bausch Health Cos., Inc. ....	6.13%	04/15/2025	3,258	3,290,972	0.0
Bausch Health Cos., Inc. ....	6.25%	02/15/2029	9,519	8,111,625	0.1
Bausch Health Cos., Inc. ....	7.25%	05/30/2029	9,800	8,566,438	0.1
Bausch Health Cos., Inc. ....	9.00%	12/15/2025	6,654	6,919,198	0.0
CD&R Smokey Buyer, Inc. ....	6.75%	07/15/2025	11,430	11,804,853	0.1
Charles River Laboratories International, Inc. ....	3.75%	03/15/2029	1,000	960,789	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc. ....	5.63%	03/15/2027	7,408	7,466,504	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc. ....	6.00%	01/15/2029	7,082	7,122,739	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc. ....	6.13%	04/01/2030	17,452	16,230,103	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc. ....	6.88%	04/01/2028	2,000	1,847,003	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc. ....	6.88%	04/15/2029	33,534	32,461,503	0.2
DaVita, Inc. ....	4.63%	06/01/2030	2,000	1,917,449	0.0
Elanco Animal Health, Inc. ....	5.77%	08/28/2023	1,000	1,030,767	0.0
Elanco Animal Health, Inc. ....	6.40%	08/28/2028	2,000	2,167,227	0.0
Endo Luxembourg Finance Co. I SARL/Endo US, Inc. ....	6.13%	04/01/2029	2,000	1,884,149	0.0
Global Medical Response, Inc. ....	6.50%	10/01/2025	29,645	29,091,131	0.2
Grifols Escrow Issuer SA ....	4.75%	10/15/2028	12,153	11,447,997	0.1
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc. ....	7.00%	12/31/2027	55,853	47,281,877	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Lamb Weston Holdings, Inc. ....	4.13%	01/31/2030	USD 1,000	\$ 966,824	0.0%
Legacy LifePoint Health LLC .....	4.38%	02/15/2027	1,000	954,364	0.0
Legacy LifePoint Health LLC .....	6.75%	04/15/2025	1,667	1,726,484	0.0
LifePoint Health, Inc. ....	5.38%	01/15/2029	3,000	2,816,251	0.0
Mallinckrodt International Finance SA/Mallinckrodt CB LLC(c) .	5.50%	04/15/2025	3,859	1,945,225	0.0
Mallinckrodt International Finance SA/Mallinckrodt CB LLC(c) .	5.63%	10/15/2023	5,298	2,637,316	0.0
ModivCare Escrow Issuer, Inc. ....	5.00%	10/01/2029	3,999	3,766,279	0.0
ModivCare, Inc. ....	5.88%	11/15/2025	3,735	3,745,034	0.0
Mozart Debt Merger Sub, Inc. ....	3.88%	04/01/2029	23,239	22,068,559	0.1
Mozart Debt Merger Sub, Inc. ....	5.25%	10/01/2029	40,404	38,710,491	0.2
Option Care Health, Inc. ....	4.38%	10/31/2029	26,265	25,214,505	0.2
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV .....	5.13%	04/30/2031	18,518	18,495,762	0.1
Par Pharmaceutical, Inc. ....	7.50%	04/01/2027	6,263	6,271,685	0.0
Post Holdings, Inc. ....	5.50%	12/15/2029	26,783	27,002,817	0.2
Post Holdings, Inc. ....	5.63%	01/15/2028	3,097	3,119,010	0.0
Radiology Partners, Inc. ....	9.25%	02/01/2028	36,585	36,520,663	0.2
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc./ LifePoint Health, Inc. ....	9.75%	12/01/2026	47,895	50,253,453	0.3
RP Escrow Issuer LLC .....	5.25%	12/15/2025	9,009	8,870,919	0.1
Tempur Sealy International, Inc. ....	3.88%	10/15/2031	1,000	898,633	0.0
Tenet Healthcare Corp. ....	6.25%	02/01/2027	5,000	5,141,392	0.0
Triton Water Holdings, Inc. ....	6.25%	04/01/2029	16,820	15,507,610	0.1
US Acute Care Solutions LLC .....	6.38%	03/01/2026	14,091	13,855,031	0.1
US Foods, Inc. ....	4.63%	06/01/2030	20,566	19,954,633	0.1
US Renal Care, Inc. ....	10.63%	07/15/2027	35,766	35,749,357	0.2
Vizient, Inc. ....	6.25%	05/15/2027	4,262	4,413,295	0.0
WASH Multifamily Acquisition, Inc. ....	5.75%	04/15/2026	5,687	5,722,175	0.0
				655,607,826	3.7

ENERGIE

Antero Resources Corp. ....	5.00%	03/01/2025	4,000	4,050,000	0.0
Antero Resources Corp. ....	7.63%	02/01/2029	2,486	2,693,632	0.0
Antero Resources Corp. ....	8.38%	07/15/2026	13,544	14,874,459	0.1
Apache Corp. ....	4.25%	01/15/2030	10,000	9,968,704	0.1
Athabasca Oil Corp. ....	9.75%	11/01/2026	24,824	25,946,045	0.2
Berry Petroleum Co. LLC .....	7.00%	02/15/2026	18,888	18,653,012	0.1
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp. ....	6.63%	07/15/2026	5,384	5,553,656	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp. ....	7.63%	12/15/2025	14,861	15,605,868	0.1
Callon Petroleum Co. ....	8.00%	08/01/2028	24,696	25,578,724	0.1
Callon Petroleum, Co. ....	8.25%	07/15/2025	6,693	6,670,773	0.0
Callon Petroleum, Co. ....	9.00%	04/01/2025	6,226	6,667,495	0.0
CITGO Petroleum Corp. ....	6.38%	06/15/2026	11,351	11,262,890	0.1
CITGO Petroleum Corp. ....	7.00%	06/15/2025	37,747	37,843,748	0.2
Civitas Resources, Inc. ....	5.00%	10/15/2026	5,264	5,189,932	0.0
Civitas Resources, Inc. ....	7.50%	04/30/2026	968	963,323	0.0
CNX Resources Corp. ....	6.00%	01/15/2029	15,392	15,729,480	0.1
CNX Resources Corp. ....	7.25%	03/14/2027	3,321	3,511,530	0.0
Comstock Resources, Inc. ....	5.88%	01/15/2030	7,503	7,264,367	0.0
Comstock Resources, Inc. ....	6.75%	03/01/2029	14,500	14,765,673	0.1
Comstock Resources, Inc. ....	7.50%	05/15/2025	3,753	3,830,008	0.0
CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC .....	5.50%	06/15/2031	24,829	24,706,213	0.1
Crescent Energy Finance LLC .....	7.25%	05/01/2026	22,728	22,675,442	0.1
Diamond Foreign Asset Co./Diamond Finance LLC(a) .....	9.00%	04/22/2027	2,012	2,010,340	0.0
Encino Acquisition Partners Holdings LLC .....	8.50%	05/01/2028	35,107	35,528,550	0.2
EnLink Midstream LLC .....	5.63%	01/15/2028	23,392	23,784,262	0.1
EnLink Midstream Partners LP .....	4.15%	06/01/2025	1,667	1,673,088	0.0
EnLink Midstream Partners LP .....	4.40%	04/01/2024	1,257	1,280,869	0.0
EnLink Midstream Partners LP .....	5.05%	04/01/2045	12,856	10,636,432	0.1
EnLink Midstream Partners LP .....	5.45%	06/01/2047	8,848	7,517,029	0.0
EnLink Midstream Partners LP .....	5.60%	04/01/2044	10,151	8,757,164	0.1
EQT Corp. ....	3.90%	10/01/2027	10,000	10,114,567	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp. ....	5.63%	06/15/2024	10,368	10,259,037	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp. ....	6.25%	05/15/2026	6,765	6,545,065	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp. ....	6.50%	10/01/2025	13,124	12,955,928	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp. ....	7.75%	02/01/2028	20,791	20,515,471	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp. ....	8.00%	01/15/2027	16,614	16,797,068	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp. ....	6.88%	01/15/2029	8,328	8,449,233	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp. ....	7.00%	08/01/2027	9,867	10,017,516	0.1
Gulfport Energy Corp. ....	8.00%	05/17/2026	23,416	24,732,925	0.1
Harbour Energy PLC .....	5.50%	10/15/2026	13,616	13,333,137	0.1
Hess Midstream Operations LP .....	4.25%	02/15/2030	13,259	12,808,675	0.1
Hess Midstream Operations LP .....	5.63%	02/15/2026	10,815	11,064,586	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co. ....	5.75%	02/01/2029	9,328	9,365,221	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co. ....	6.00%	02/01/2031	USD 12,329	\$ 12,520,146	0.1%
Ithaca Energy North Sea PLC .....	9.00%	07/15/2026	8,054	8,088,848	0.0
ITT Holdings LLC .....	6.50%	08/01/2029	42,848	40,162,990	0.2
Moss Creek Resources Holdings, Inc. ....	7.50%	01/15/2026	58,760	51,852,954	0.3
Nabors Industries Ltd. ....	7.25%	01/15/2026	20,063	19,541,650	0.1
Nabors Industries Ltd. ....	7.50%	01/15/2028	20,724	19,837,993	0.1
Nabors Industries, Inc. ....	7.38%	05/15/2027	27,206	28,182,400	0.2
Neptune Energy Bondco PLC .....	6.63%	05/15/2025	2,425	2,432,706	0.0
New Fortress Energy, Inc. ....	6.75%	09/15/2025	35,027	33,653,713	0.2
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp. ....	7.50%	02/01/2026	48,515	48,711,519	0.3
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp. ....	6.13%	03/01/2025	2,000	1,730,182	0.0
Occidental Petroleum Corp. ....	2.70%	02/15/2023	16,135	16,136,539	0.1
Occidental Petroleum Corp. ....	3.40%	04/15/2026	1,329	1,331,086	0.0
Occidental Petroleum Corp. ....	5.50%	12/01/2025	5,236	5,621,596	0.0
Occidental Petroleum Corp. ....	5.88%	09/01/2025	4,883	5,245,078	0.0
Occidental Petroleum Corp. ....	6.13%	01/01/2031	7,692	8,742,008	0.1
Occidental Petroleum Corp. ....	8.00%	07/15/2025	7,644	8,642,318	0.1
Occidental Petroleum Corp. ....	8.50%	07/15/2027	3,851	4,643,325	0.0
Occidental Petroleum Corp. ....	8.88%	07/15/2030	8,851	11,408,482	0.1
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp. ....	9.25%	05/15/2025	21,954	22,336,476	0.1
PDC Energy, Inc. ....	5.75%	05/15/2026	16,387	16,663,809	0.1
PDC Energy, Inc. ....	6.13%	09/15/2024	6,662	6,733,029	0.0
Range Resources Corp. ....	5.00%	03/15/2023	6,864	6,941,533	0.0
Range Resources Corp. ....	8.25%	01/15/2029	11,437	12,509,451	0.1
Renewable Energy Group, Inc. ....	5.88%	06/01/2028	6,198	6,693,971	0.0
SM Energy Co. ....	6.50%	07/15/2028	8,778	8,989,856	0.1
SM Energy Co. ....	6.63%	01/15/2027	2,000	2,029,707	0.0
SM Energy Co. ....	6.75%	09/15/2026	17,000	17,234,342	0.1
Southwestern Energy Co. ....	5.38%	02/01/2029	18,012	18,524,496	0.1
Southwestern Energy Co. ....	8.38%	09/15/2028	9,087	9,921,391	0.1
Summit Midstream Holdings LLC/ Summit Midstream Finance Corp. ....	8.50%	10/15/2026	18,457	18,279,800	0.1
Sunnova Energy Corp. ....	5.88%	09/01/2026	12,285	11,244,510	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp. ....	5.88%	03/15/2028	26,261	26,720,568	0.2
Talos Production, Inc. ....	12.00%	01/15/2026	19,483	20,607,592	0.1
Transocean Phoenix 2 Ltd. ....	7.75%	10/15/2024	10,405	10,547,697	0.1
Transocean Poseidon Ltd. ....	6.88%	02/01/2027	938	914,008	0.0
Transocean, Inc. ....	7.25%	11/01/2025	72	56,057	0.0
Transocean, Inc. ....	7.50%	01/15/2026	27,681	21,435,384	0.1
Transocean, Inc. ....	8.00%	02/01/2027	4,000	2,964,897	0.0
Transocean, Inc. ....	11.50%	01/30/2027	5,345	5,344,811	0.0
Venture Global Calcasieu Pass LLC .....	4.13%	08/15/2031	4,979	4,930,150	0.0
W&T Offshore, Inc. ....	9.75%	11/01/2023	23,933	23,503,753	0.1
Weatherford International Ltd. ....	11.00%	12/01/2024	117	121,095	0.0
				<u>1,145,885,053</u>	<u>6.5</u>
<b>SONSTIGE INDUSTRIEWERTE</b>					
Interface, Inc. ....	5.50%	12/01/2028	4,882	4,917,767	0.0
KAR Auction Services, Inc. ....	5.13%	06/01/2025	1,160	1,175,421	0.0
Ritchie Bros Holdings, Inc. ....	4.75%	12/15/2031	5,695	5,666,537	0.1
				<u>11,759,725</u>	<u>0.1</u>
<b>Dienstleistungen</b>					
ADT Security Corp. (The) .....	4.13%	08/01/2029	1,000	945,955	0.0
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp. ....	6.00%	06/01/2029	13,593	12,710,644	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp. ....	6.63%	07/15/2026	22,051	22,596,704	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp. ....	9.75%	07/15/2027	20,978	22,028,487	0.1
ANGI Group LLC .....	3.88%	08/15/2028	1,000	895,286	0.0
APCOA Parking Holdings GmbH .....	4.63%	01/15/2027	EUR 8,760	9,331,042	0.1
Aptim Corp. ....	7.75%	06/15/2025	USD 34,041	28,970,653	0.2
APX Group, Inc. ....	5.75%	07/15/2029	41,964	37,695,012	0.2
APX Group, Inc. ....	6.75%	02/15/2027	8,465	8,694,196	0.0
Aramark Services, Inc. ....	6.38%	05/01/2025	20,566	21,293,272	0.1
Cars.com, Inc. ....	6.38%	11/01/2028	16,622	16,778,196	0.1
CWT Travel Group, Inc. ....	8.50%	11/19/2026	21,705	21,918,840	0.1
Garda World Security Corp. ....	4.63%	02/15/2027	2,000	1,936,866	0.0
Garda World Security Corp. ....	6.00%	06/01/2029	15,311	14,030,735	0.1
Garda World Security Corp. ....	9.50%	11/01/2027	21,365	22,127,887	0.1
ION Trading Technologies SARL .....	5.75%	05/15/2028	8,833	8,714,033	0.1
Korn Ferry .....	4.63%	12/15/2027	17,280	17,020,800	0.1
Millennium Escrow Corp. ....	6.63%	08/01/2026	30,817	30,046,879	0.2
MoneyGram International, Inc. ....	5.38%	08/01/2026	12,901	13,469,363	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC .....	5.50%	09/01/2028	23,935	23,148,307	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC .....	5.75%	11/01/2028	59,950	54,091,754	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co. ....	5.63%	10/01/2028	USD 10,955	\$ 10,599,047	0.1%
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co. ....	5.88%	10/01/2030	11,761	11,394,424	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc. ....	5.75%	04/15/2026	3,000	3,082,712	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc. ....	6.25%	01/15/2028	51,628	49,830,707	0.3
Sabre GLBL, Inc. ....	7.38%	09/01/2025	17,465	18,105,129	0.1
Sabre GLBL, Inc. ....	9.25%	04/15/2025	12,443	14,037,469	0.1
TripAdvisor, Inc. ....	7.00%	07/15/2025	15,163	15,776,875	0.1
Verisure Midholding AB ....	5.25%	02/15/2029	EUR 21,242	22,393,513	0.1
Verscend Escrow Corp. ....	9.75%	08/15/2026	USD 57,645	60,424,399	0.3
ZipRecruiter, Inc. ....	5.00%	01/15/2030	25,440	25,069,141	0.1
				<u>619,158,327</u>	<u>3.5</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Ahead DB Holdings LLC ....	6.63%	05/01/2028	21,260	20,138,436	0.1
Austin BidCo, Inc. ....	7.13%	12/15/2028	17,654	17,345,069	0.1
Avaya, Inc. ....	6.13%	09/15/2028	45,942	44,397,623	0.3
Boxer Parent Co., Inc. ....	7.13%	10/02/2025	14,476	14,986,375	0.1
Cablevision Lightpath LLC ....	5.63%	09/15/2028	16,278	14,838,652	0.1
Clarivate Science Holdings Corp. ....	4.88%	07/01/2029	9,245	8,702,388	0.0
CommScope, Inc. ....	4.75%	09/01/2029	5,241	4,924,865	0.0
CommScope, Inc. ....	6.00%	03/01/2026	15,921	16,303,564	0.1
CommScope, Inc. ....	8.25%	03/01/2027	6,325	6,292,058	0.0
Dell International LLC/EMC Corp. ....	5.85%	07/15/2025	9,315	10,237,931	0.1
LogMeIn, Inc. ....	5.50%	09/01/2027	13,368	12,726,000	0.1
Minerva Merger Sub, Inc. ....	6.50%	02/15/2030	46,108	44,369,124	0.2
NCR Corp. ....	5.00%	10/01/2028	3,000	2,948,791	0.0
NCR Corp. ....	5.75%	09/01/2027	11,568	11,747,822	0.1
NCR Corp. ....	6.13%	09/01/2029	11,508	11,945,498	0.1
Playtika Holding Corp. ....	4.25%	03/15/2029	1,000	947,705	0.0
Presidio Holdings, Inc. ....	4.88%	02/01/2027	11,848	11,910,652	0.1
Presidio Holdings, Inc. ....	8.25%	02/01/2028	35,003	35,840,327	0.2
Rackspace Technology Global, Inc. ....	3.50%	02/15/2028	1,000	907,732	0.0
Science Applications International Corp. ....	4.88%	04/01/2028	2,038	1,990,439	0.0
Seagate HDD Cayman ....	4.09%	06/01/2029	25,862	24,898,131	0.1
Seagate HDD Cayman ....	4.88%	06/01/2027	11,014	11,371,950	0.1
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd. ....	7.50%	09/01/2025	72,383	71,605,992	0.4
				<u>401,377,124</u>	<u>2.3</u>
<b>TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN</b>					
Air Canada ....	3.88%	08/15/2026	8,507	8,271,558	0.1
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd. ....	5.50%	04/20/2026	23,831	24,421,929	0.1
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd. ....	5.75%	04/20/2029	20,260	20,705,313	0.1
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ HawaiianMiles Loyalty Ltd. ....	5.75%	01/20/2026	13,097	13,298,159	0.1
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd. ....	8.00%	09/20/2025	20,443	22,231,798	0.1
United Airlines, Inc. ....	4.63%	04/15/2029	7,072	6,905,369	0.1
				<u>95,834,126</u>	<u>0.6</u>
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
AerCap Global Aviation Trust ....	6.50%	06/15/2045	5,371	5,633,043	0.0
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc. ....	5.25%	10/15/2026	EUR 19,265	21,260,725	0.1
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc. ....	6.13%	10/15/2026	USD 14,925	14,512,110	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc. ....	5.38%	03/01/2029	16,633	16,352,870	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc. ....	5.75%	07/15/2027	32,463	32,743,774	0.2
BCP V Modular Services ....	6.75%	11/30/2029	EUR 31,430	32,254,154	0.2
BCP V Modular Services Finance II PLC ....	4.75%	11/30/2028	3,116	3,321,518	0.0
Herc Holdings, Inc. ....	5.50%	07/15/2027	USD 17,323	17,813,346	0.1
PROG Holdings, Inc. ....	6.00%	11/15/2029	31,813	30,541,363	0.2
United Rentals North America, Inc. ....	4.00%	07/15/2030	2,000	1,965,164	0.0
				<u>176,398,067</u>	<u>1.0</u>
				<u>7,172,723,379</u>	<u>40.9</u>
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Alliance Data Systems Corp. ....	4.75%	12/15/2024	24,532	24,468,185	0.1
Alliance Data Systems Corp. ....	7.00%	01/15/2026	11,510	11,812,138	0.1
Ally Financial, Inc., Series C(d) ....	4.70%	05/15/2028	16,427	15,236,042	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(d) ....	5.88%	05/24/2022	EUR 16,000	17,994,647	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(d) ....	6.50%	03/05/2025	USD 41,600	41,723,224	0.2
Banco Santander SA(d) ....	6.75%	04/25/2022	EUR 39,400	44,494,421	0.3
Bank of Ireland, Series E ....	10.00%	12/19/2022	15,000	18,041,288	0.1
CaixaBank SA(d) ....	5.88%	10/09/2027	200	237,425	0.0
Citizens Financial Group, Inc., Series B(d) ....	6.00%	07/06/2023	USD 8,895	8,666,464	0.0
Credit Suisse Group AG(d) ....	6.25%	12/18/2024	31,464	32,247,408	0.2
Credit Suisse Group AG(d) ....	7.50%	07/17/2023	35,155	35,958,236	0.2
Credit Suisse Group AG(d) ....	7.50%	12/11/2023	10,650	11,159,576	0.1
Intesa Sanpaolo SpA ....	5.02%	06/26/2024	206	211,721	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Intesa Sanpaolo SpA . . . . .	5.71%	01/15/2026	USD 11,463	\$ 12,120,827	0.1%
Societe Generale SA(d) . . . . .	8.00%	09/29/2025	44,504	48,428,168	0.3
UniCredit SpA(d) . . . . .	9.25%	06/03/2022	EUR 21,339	24,341,638	0.1
				<u>347,141,408</u>	<u>2.0</u>
<b>MAKLER</b>					
Advisor Group Holdings, Inc. . . . .	10.75%	08/01/2027	USD 18,913	20,621,758	0.1
Jane Street Group/JSG Finance, Inc. . . . .	4.50%	11/15/2029	17,256	16,815,501	0.1
NFP Corp. . . . .	6.88%	08/15/2028	54,445	50,585,278	0.3
				<u>88,022,537</u>	<u>0.5</u>
<b>FINANZEN</b>					
Aircastle Ltd.(d) . . . . .	5.25%	06/15/2026	24,017	23,084,114	0.1
Castlelake Aviation Finance DAC . . . . .	5.00%	04/15/2027	10,157	9,650,578	0.1
CNG Holdings, Inc. . . . .	12.50%	06/15/2024	17,033	16,097,221	0.1
Compass Group Diversified Holdings LLC . . . . .	5.25%	04/15/2029	17,385	16,815,552	0.1
Curo Group Holdings Corp. . . . .	7.50%	08/01/2028	49,329	43,780,148	0.3
Enova International, Inc. . . . .	8.50%	09/01/2024	6,350	6,339,748	0.0
Enova International, Inc. . . . .	8.50%	09/15/2025	32,666	32,498,190	0.2
goeasy Ltd. . . . .	5.38%	12/01/2024	14,674	14,820,740	0.1
HighTower Holding, LLC . . . . .	6.75%	04/15/2029	29,639	29,544,832	0.2
ILFC E-Capital Trust I(e) . . . . .	3.37%	12/21/2065	9,500	7,787,319	0.0
Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp. . . . .	5.00%	08/15/2028	28,217	27,227,224	0.2
Navient Corp. . . . .	5.00%	03/15/2027	3,200	3,105,929	0.0
Navient Corp. . . . .	5.88%	10/25/2024	1,000	1,034,393	0.0
Navient Corp. . . . .	7.25%	09/25/2023	182	190,936	0.0
OneMain Finance Corp. . . . .	6.88%	03/15/2025	6,000	6,402,226	0.0
Springleaf Finance Corp. . . . .	7.13%	03/15/2026	3,000	3,253,278	0.0
				<u>241,632,428</u>	<u>1.4</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc. . . . .	6.00%	08/01/2029	2,239	2,028,863	0.0
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc. . . . .	7.00%	11/15/2025	25,698	25,546,714	0.2
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc. . . . .	10.13%	08/01/2026	19,929	21,121,128	0.1
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer. . . . .	6.75%	10/15/2027	35,347	34,574,943	0.2
AmWINS Group, Inc. . . . .	4.88%	06/30/2029	8,871	8,488,299	0.1
Ardonagh Midco 2 PLC(a) . . . . .	11.50%	01/15/2027	36,941	40,106,006	0.2
AssuredPartners, Inc. . . . .	5.63%	01/15/2029	35,614	32,770,492	0.2
HUB International Ltd. . . . .	7.00%	05/01/2026	5,000	5,058,882	0.0
USI, Inc./NY . . . . .	6.88%	05/01/2025	2,000	2,010,401	0.0
				<u>171,705,728</u>	<u>1.0</u>
<b>SONSTIGE FINANZWERTE</b>					
Altice France Holding SA . . . . .	10.50%	05/15/2027	16,348	17,115,566	0.1
Asteroid Private Merger Sub, Inc. . . . .	8.50%	11/15/2029	31,547	30,435,666	0.1
Intrum AB . . . . .	3.50%	07/15/2026	EUR 16,915	17,922,816	0.1
Intrum AB . . . . .	4.88%	08/15/2025	10,509	11,761,702	0.1
				<u>77,235,750</u>	<u>0.4</u>
<b>REITS</b>					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL . . . . .	4.50%	04/01/2027	USD 26,418	24,636,250	0.1
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL . . . . .	5.75%	05/15/2026	8,837	8,745,762	0.1
Diversified Healthcare Trust . . . . .	4.75%	02/15/2028	3,000	2,720,899	0.0
Diversified Healthcare Trust . . . . .	9.75%	06/15/2025	23,996	25,375,319	0.1
Iron Mountain UK PLC . . . . .	3.88%	11/15/2025	GBP 1,000	1,332,488	0.0
Iron Mountain, Inc. . . . .	4.88%	09/15/2027	USD 1,028	1,026,957	0.0
Iron Mountain, Inc. . . . .	4.88%	09/15/2029	13,788	13,305,420	0.1
Iron Mountain, Inc. . . . .	5.00%	07/15/2028	10,641	10,550,776	0.1
Iron Mountain, Inc. . . . .	5.25%	03/15/2028	2,653	2,656,420	0.0
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc. . . . .	4.63%	06/15/2025	4,985	5,161,741	0.0
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc. . . . .	5.63%	05/01/2024	3,667	3,813,685	0.0
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc. . . . .	5.75%	02/01/2027	2,493	2,702,127	0.0
Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/ PK Finance Co-Issuer . . . . .	4.88%	05/15/2029	9,031	8,709,648	0.1
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc. . . . .	4.13%	08/15/2030	3,000	2,980,088	0.0
				<u>113,717,580</u>	<u>0.6</u>
				<u>1,039,455,431</u>	<u>5.9</u>
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
Calpine Corp. . . . .	4.50%	02/15/2028	1,000	975,930	0.0
Calpine Corp. . . . .	4.63%	02/01/2029	1,000	929,891	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Calpine Corp.....	5.00%	02/01/2031	USD 4,000	\$ 3,693,016	0.0%
Calpine Corp.....	5.13%	03/15/2028	17,753	17,120,018	0.1
Calpine Corp.....	5.25%	06/01/2026	661	672,267	0.0
NRG Energy, Inc.....	6.63%	01/15/2027	334	345,956	0.0
Talen Energy Supply LLC .....	6.50%	06/01/2025	30,480	12,797,321	0.1
Talen Energy Supply LLC .....	7.25%	05/15/2027	6,399	5,727,742	0.0
Talen Energy Supply LLC .....	10.50%	01/15/2026	58,233	26,814,868	0.1
Vistra Corp.(d) .....	7.00%	12/15/2026	14,856	14,746,997	0.1
Vistra Corp.(d) .....	8.00%	10/15/2026	17,732	18,247,062	0.1
				<u>102,071,068</u>	<u>0.5</u>
<b>SONSTIGE VERSORGENSBETRIEBE</b>					
Solaris Midstream Holdings LLC .....	7.63%	04/01/2026	11,409	11,669,961	0.1
				<u>113,741,029</u>	<u>0.6</u>
<b>QUASI-STAAATSANLEIHEN</b>					
<b>ENERGIE</b>					
Citgo Holding, Inc. ....	9.25%	08/01/2024	31,077	31,074,302	0.2
<b>WANDELANLEIHEN</b>					
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
DISH Network Corp.(b).....	3.38%	08/15/2026	6,494	5,921,190	0.0
				<u>8,362,915,331</u>	<u>47.6</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG</b>					
<b>STAATSANLEIHEN</b>					
<b>ANGOLA</b>					
Angolan Government International Bond .....	8.00%	11/26/2029	61,420	60,345,150	0.3
Angolan Government International Bond .....	8.25%	05/09/2028	28,770	28,698,075	0.2
Angolan Government International Bond .....	9.13%	11/26/2049	56,178	52,105,095	0.3
Angolan Government International Bond .....	9.38%	05/08/2048	10,509	9,931,005	0.1
				<u>151,079,325</u>	<u>0.9</u>
<b>ARGENTINIEN</b>					
Argentine Republic Government International Bond .....	0.50%	07/09/2030	82,924	26,452,677	0.1
Argentine Republic Government International Bond .....	1.00%	07/09/2029	20,068	6,612,248	0.0
Argentine Republic Government International Bond .....	1.13%	07/09/2035	218,948	64,918,035	0.4
Argentine Republic Government International Bond .....	2.00%	01/09/2038	24,411	9,031,993	0.1
Argentine Republic Government International Bond .....	2.50%	07/09/2041	30,585	10,398,870	0.1
				<u>117,413,823</u>	<u>0.7</u>
<b>KOLUMBIEN</b>					
Colombia Government International Bond .....	5.63%	02/26/2044	17,589	15,778,432	0.1
Colombia Government International Bond .....	6.13%	01/18/2041	9,337	9,023,627	0.0
Colombia Government International Bond .....	7.38%	09/18/2037	13,795	15,289,171	0.1
				<u>40,091,230</u>	<u>0.2</u>
<b>COSTA RICA</b>					
Costa Rica Government International Bond .....	6.13%	02/19/2031	32,771	32,439,194	0.2
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>					
Dominican Republic International Bond .....	5.50%	01/27/2025	3,775	3,926,000	0.0
Dominican Republic International Bond .....	5.88%	01/30/2060	14,092	11,857,537	0.1
Dominican Republic International Bond .....	5.95%	01/25/2027	27,913	29,029,520	0.1
Dominican Republic International Bond .....	6.00%	07/19/2028	63,400	65,412,950	0.4
Dominican Republic International Bond .....	6.50%	02/15/2048	7,709	7,235,860	0.0
Dominican Republic International Bond .....	6.88%	01/29/2026	9,441	10,290,690	0.1
Dominican Republic International Bond .....	7.45%	04/30/2044	17,877	18,729,509	0.1
Dominican Republic International Bond .....	8.63%	04/20/2027	16,359	18,362,978	0.1
				<u>164,845,044</u>	<u>0.9</u>
<b>ECUADOR</b>					
Ecuador Government International Bond .....	0.00%	07/31/2030	5,863	3,447,225	0.0
Ecuador Government International Bond .....	0.50%	07/31/2040	16,709	10,393,757	0.1
Ecuador Government International Bond .....	1.00%	07/31/2035	92,884	65,500,516	0.4
Ecuador Government International Bond .....	5.00%	07/31/2030	27,255	23,972,260	0.1
				<u>103,313,758</u>	<u>0.6</u>
<b>ÄGYPTEN</b>					
Egypt Government International Bond .....	3.88%	02/16/2026	5,392	4,670,820	0.0
Egypt Government International Bond .....	5.88%	02/16/2031	1,655	1,282,625	0.0
Egypt Government International Bond .....	6.20%	03/01/2024	28,900	29,044,500	0.2
Egypt Government International Bond .....	6.59%	02/21/2028	7,360	6,550,400	0.0
Egypt Government International Bond .....	7.30%	09/30/2033	3,437	2,809,748	0.0
Egypt Government International Bond .....	7.50%	01/31/2027	15,058	14,455,680	0.1
Egypt Government International Bond .....	7.60%	03/01/2029	16,788	15,067,230	0.1
Egypt Government International Bond .....	7.63%	05/29/2032	43,364	36,208,940	0.2
Egypt Government International Bond .....	8.50%	01/31/2047	7,580	5,836,600	0.0
Egypt Government International Bond .....	8.70%	03/01/2049	10,320	8,075,400	0.1



**AB FCP I**  
**Global High Yield Portfolio**

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Egypt Government International Bond . . . . .	8.88%	05/29/2050	USD 22,855	\$ 17,998,312	0.1%
				<u>142,000,255</u>	<u>0.8</u>
<b>EL SALVADOR</b>					
El Salvador Government International Bond . . . . .	5.88%	01/30/2025	19,017	11,455,365	0.1
El Salvador Government International Bond . . . . .	6.38%	01/18/2027	8,560	4,674,830	0.0
El Salvador Government International Bond . . . . .	7.12%	01/20/2050	34,297	16,736,936	0.1
El Salvador Government International Bond . . . . .	7.63%	02/01/2041	7,141	3,582,997	0.0
El Salvador Government International Bond . . . . .	7.65%	06/15/2035	1,843	963,313	0.0
				<u>37,413,441</u>	<u>0.2</u>
<b>GABUN</b>					
Gabon Government International Bond . . . . .	6.63%	02/06/2031	28,288	25,720,864	0.2
Gabon Government International Bond . . . . .	6.95%	06/16/2025	17,720	17,878,373	0.1
				<u>43,599,237</u>	<u>0.3</u>
<b>GHANA</b>					
Ghana Government International Bond . . . . .	7.63%	05/16/2029	17,955	12,119,625	0.1
Ghana Government International Bond . . . . .	7.75%	04/07/2029	16,009	10,846,097	0.1
Ghana Government International Bond . . . . .	7.88%	03/26/2027	20,893	14,938,495	0.1
Ghana Government International Bond . . . . .	8.13%	01/18/2026	10,000	7,750,000	0.0
Ghana Government International Bond . . . . .	8.13%	03/26/2032	31,733	21,261,110	0.1
Ghana Government International Bond . . . . .	8.63%	04/07/2034	11,455	7,588,938	0.0
Ghana Government International Bond . . . . .	8.63%	06/16/2049	25,866	16,748,235	0.1
Ghana Government International Bond . . . . .	8.95%	03/26/2051	6,050	3,932,500	0.0
Ghana Government International Bond . . . . .	10.75%	10/14/2030	11,717	11,365,490	0.1
				<u>106,550,490</u>	<u>0.6</u>
<b>HONDURAS</b>					
Honduras Government International Bond . . . . .	6.25%	01/19/2027	29,458	26,526,929	0.1
Honduras Government International Bond . . . . .	7.50%	03/15/2024	13,637	13,064,246	0.1
				<u>39,591,175</u>	<u>0.2</u>
<b>IRAK</b>					
Iraq International Bond . . . . .	5.80%	01/15/2028	20,383	19,539,414	0.1
<b>ELFENBEINKÜSTE</b>					
Ivory Coast Government International Bond . . . . .	4.88%	01/30/2032	EUR 43,563	41,588,476	0.3
Ivory Coast Government International Bond . . . . .	5.13%	06/15/2025	3,272	3,874,637	0.0
Ivory Coast Government International Bond . . . . .	6.13%	06/15/2033	USD 6,219	5,985,010	0.0
Ivory Coast Government International Bond . . . . .	6.38%	03/03/2028	44,268	45,299,998	0.3
Ivory Coast Government International Bond . . . . .	6.88%	10/17/2040	EUR 39,053	39,828,082	0.2
				<u>136,576,203</u>	<u>0.8</u>
<b>JAMAICA</b>					
Jamaica Government International Bond . . . . .	6.75%	04/28/2028	USD 4,743	5,227,082	0.0
<b>KENIA</b>					
Republic of Kenya Government International Bond . . . . .	6.88%	06/24/2024	30,874	31,954,590	0.1
Republic of Kenya Government International Bond . . . . .	7.00%	05/22/2027	16,016	15,295,280	0.1
Republic of Kenya Government International Bond . . . . .	7.25%	02/28/2028	9,643	9,112,635	0.1
				<u>56,362,505</u>	<u>0.3</u>
<b>LIBANON</b>					
Lebanon Government International Bond, Series G(c) . . . . .	6.60%	11/27/2026	10,759	1,264,182	0.0
Lebanon Government International Bond(c) . . . . .	6.65%	04/22/2024	4,315	507,013	0.0
Lebanon Government International Bond(c) . . . . .	6.85%	03/23/2027	5,606	658,705	0.0
				<u>2,429,900</u>	<u>0.0</u>
<b>NIGERIA</b>					
Nigeria Government International Bond . . . . .	6.13%	09/28/2028	12,918	11,915,240	0.1
Nigeria Government International Bond . . . . .	6.38%	07/12/2023	8,691	8,930,003	0.1
Nigeria Government International Bond . . . . .	6.50%	11/28/2027	4,404	4,183,800	0.0
Nigeria Government International Bond . . . . .	7.14%	02/23/2030	24,937	23,253,752	0.1
Nigeria Government International Bond . . . . .	7.63%	11/21/2025	31,750	33,655,000	0.1
Nigeria Government International Bond . . . . .	7.63%	11/28/2047	15,679	12,660,793	0.1
Nigeria Government International Bond . . . . .	7.70%	02/23/2038	14,105	11,918,725	0.1
Nigeria Government International Bond . . . . .	7.88%	02/16/2032	43,612	40,068,525	0.2
				<u>146,585,838</u>	<u>0.8</u>
<b>PAKISTAN</b>					
Pakistan Government International Bond . . . . .	6.00%	04/08/2026	15,032	13,718,354	0.1
Pakistan Government International Bond . . . . .	6.88%	12/05/2027	918	849,035	0.0
Pakistan Government International Bond . . . . .	7.38%	04/08/2031	25,092	21,519,150	0.1
				<u>36,086,539</u>	<u>0.2</u>
<b>SÜDAFRIKA</b>					
Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	4.30%	10/12/2028	21,899	21,013,459	0.1
Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	4.85%	09/30/2029	20,001	19,504,725	0.1
Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	5.65%	09/27/2047	8,663	7,422,026	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	5.75%	09/30/2049	USD 103,528	\$ 89,150,549	0.5%
Republic of South Africa Government International Bond . . . . .	6.30%	06/22/2048	1,684	1,571,698	0.0
				<u>138,662,457</u>	<u>0.8</u>
<b>UKRAINE</b>					
Ukraine Government International Bond . . . . .	7.25%	03/15/2033	37,766	12,085,120	0.1
Ukraine Government International Bond . . . . .	7.38%	09/25/2032	24,077	7,704,640	0.1
Ukraine Government International Bond . . . . .	7.75%	09/01/2023	45,102	18,040,800	0.1
Ukraine Government International Bond . . . . .	7.75%	09/01/2024	38,721	12,390,720	0.1
Ukraine Government International Bond . . . . .	7.75%	09/01/2025	10,000	3,200,000	0.0
Ukraine Government International Bond . . . . .	7.75%	09/01/2027	13,037	4,171,840	0.0
Ukraine Government International Bond . . . . .	9.75%	11/01/2028	9,111	2,915,520	0.0
				<u>60,508,640</u>	<u>0.4</u>
<b>VENEZUELA</b>					
Venezuela Government International Bond(c) . . . . .	9.00%	05/07/2023	4,270	234,850	0.0
Venezuela Government International Bond(c) . . . . .	9.25%	09/15/2027	57,269	3,149,795	0.0
				<u>3,384,645</u>	<u>0.0</u>
				<u>1,583,700,195</u>	<u>9.0</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Braskem Idesa SAPI . . . . .	6.99%	02/20/2032	8,549	8,164,295	0.0
Braskem Idesa SAPI . . . . .	7.45%	11/15/2029	24,763	24,589,659	0.1
Braskem Netherlands Finance BV . . . . .	4.50%	01/10/2028	10,931	10,985,108	0.1
Braskem Netherlands Finance BV . . . . .	4.50%	01/31/2030	32,575	32,086,375	0.2
Cia de Minas Buenaventura SAA . . . . .	5.50%	07/23/2026	10,002	9,873,224	0.1
CSN Inova Ventures . . . . .	6.75%	01/28/2028	14,737	15,296,221	0.1
CSN Resources SA . . . . .	7.63%	04/17/2026	12,983	13,537,881	0.1
Eldorado Gold Corp. . . . .	6.25%	09/01/2029	20,939	20,939,000	0.1
First Quantum Minerals Ltd. . . . .	6.88%	10/15/2027	33,725	35,693,528	0.2
First Quantum Minerals Ltd. . . . .	7.25%	04/01/2023	13,290	13,310,766	0.1
First Quantum Minerals Ltd. . . . .	7.50%	04/01/2025	10,621	10,836,739	0.1
HTA Group Ltd./Mauritius . . . . .	7.00%	12/18/2025	14,504	14,649,040	0.1
Indika Energy Capital IV Pte Ltd. . . . .	8.25%	10/22/2025	30,464	29,854,720	0.1
JSW Steel Ltd. . . . .	3.95%	04/05/2027	4,086	3,881,700	0.0
JSW Steel Ltd. . . . .	5.95%	04/18/2024	9,640	9,917,150	0.1
Nexa Resources SA . . . . .	6.50%	01/18/2028	22,620	23,557,316	0.1
OCP SA . . . . .	3.75%	06/23/2031	7,803	6,837,379	0.0
Sasol Financing USA LLC . . . . .	5.88%	03/27/2024	9,655	9,809,480	0.1
Stillwater Mining Co. . . . .	4.00%	11/16/2026	10,431	9,987,683	0.1
Stillwater Mining Co. . . . .	4.50%	11/16/2029	9,575	8,809,000	0.1
Suzano Austria GmbH . . . . .	7.00%	03/16/2047	4,960	5,648,200	0.0
Vedanta Resources Finance II PLC . . . . .	13.88%	01/21/2024	40,014	40,664,227	0.2
Volcan Cia Minera SAA . . . . .	4.38%	02/11/2026	4,778	4,538,503	0.0
				<u>363,467,194</u>	<u>2.1</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Cemex SAB de CV . . . . .	3.88%	07/11/2031	1,023	910,470	0.0
Cemex SAB de CV(d) . . . . .	5.13%	06/08/2026	17,508	16,720,140	0.1
Cemex SAB de CV . . . . .	7.38%	06/05/2027	10,634	11,365,619	0.1
Embraer Netherlands Finance BV . . . . .	5.40%	02/01/2027	26,390	26,340,519	0.2
Embraer Netherlands Finance BV . . . . .	6.95%	01/17/2028	23,369	24,286,233	0.1
IHS Holding Ltd. . . . .	5.63%	11/29/2026	7,892	7,714,430	0.1
IHS Holding Ltd. . . . .	6.25%	11/29/2028	3,321	3,229,673	0.0
Klabn Austria GmbH . . . . .	7.00%	04/03/2049	6,722	6,923,660	0.0
				<u>97,490,744</u>	<u>0.6</u>
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Globo Comunicacao e Participacoes SA . . . . .	4.88%	01/22/2030	6,730	5,995,623	0.0
VTR Finance NV . . . . .	6.38%	07/15/2028	2,602	2,615,010	0.0
				<u>8,610,633</u>	<u>0.0</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
C&W Senior Financing DAC . . . . .	6.88%	09/15/2027	25,208	26,061,567	0.2
CT Trust . . . . .	5.13%	02/03/2032	2,789	2,796,134	0.0
Digicel International Finance Ltd./ Digicel international Holdings Ltd. . . . .	8.75%	05/25/2024	4,359	4,385,699	0.0
MTN Mauritius Investments Ltd. . . . .	6.50%	10/13/2026	3,770	4,013,401	0.0
Oi Movel SA . . . . .	8.75%	07/30/2026	16,489	16,837,330	0.1
				<u>54,094,131</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026	USD 6,109	\$ 6,012,783	0.1%
BRF SA	4.88%	01/24/2030	2,443	2,319,812	0.0
BRF SA	5.75%	09/21/2050	2,952	2,630,379	0.0
Central American Bottling Corp./CBC Bottling Holdco SL/ Beliv Holdco SL	5.25%	04/27/2029	2,741	2,776,085	0.0
Cosan SA	5.50%	09/20/2029	13,818	13,742,865	0.1
Ulker Biskuvi Sanayi AS	6.95%	10/30/2025	5,581	5,098,941	0.0
				<u>32,580,865</u>	<u>0.2</u>
<b>ENERGIE</b>					
Ecopetrol SA	4.63%	11/02/2031	8,355	7,471,459	0.0
Ecopetrol SA	5.88%	11/02/2051	6,407	5,373,551	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	23,645	24,697,202	0.1
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	2,885	2,840,048	0.0
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	9,261	8,408,022	0.1
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	3,062	3,073,482	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028	1,737	1,683,989	0.0
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	8,915	9,182,450	0.1
Kosmos Energy Ltd.	7.50%	03/01/2028	13,719	12,792,967	0.1
Medco Platinum Road Pte Ltd.	6.75%	01/30/2025	15,289	15,353,978	0.1
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	11,005	10,660,911	0.1
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	3,463	3,271,020	0.0
Peru LNG SRL	5.38%	03/22/2030	22,893	19,756,659	0.1
Petrobras Global Finance BV	5.60%	01/03/2031	38,275	38,144,674	0.2
Petrobras Global Finance BV	6.75%	01/27/2041	18,520	18,841,137	0.1
Petrobras Global Finance BV	7.38%	01/17/2027	25,478	28,503,512	0.2
Petrobras Global Finance BV	8.75%	05/23/2026	12,234	14,354,305	0.1
Raizen Fuels Finance SA	5.30%	01/20/2027	7,683	7,999,348	0.0
SEPLAT Energy PLC	7.75%	04/01/2026	17,384	16,949,400	0.1
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	06/15/2028	11,029	10,019,957	0.1
				<u>259,378,071</u>	<u>1.5</u>
<b>DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Bidvest Group UK PLC (The)	3.63%	09/23/2026	7,895	7,539,725	0.1
StoneCo Ltd.	3.95%	06/16/2028	5,172	4,101,396	0.0
				<u>11,641,121</u>	<u>0.1</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	304	307,654	0.0
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	36,561	36,606,701	0.2
				<u>36,914,355</u>	<u>0.2</u>
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	9,100	8,350,160	0.0
Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA	6.75%	03/30/2029	10,660	10,606,700	0.1
JSW Infrastructure Ltd.	4.95%	01/21/2029	2,678	2,594,815	0.0
				<u>21,551,675</u>	<u>0.1</u>
				<u>885,728,789</u>	<u>5.1</u>
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Absa Group Ltd.(d)	6.38%	05/27/2026	6,561	6,413,378	0.0
BBVA Bancomer SA/Texas	5.88%	09/13/2034	3,720	3,663,270	0.0
Fidelity Bank PLC	10.50%	10/16/2022	11,480	11,600,540	0.1
				<u>21,677,188</u>	<u>0.1</u>
<b>FINANZEN</b>					
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	3.75%	04/27/2022	750	750,000	0.0
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	4.75%	04/27/2027	4,249	4,100,285	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.25%	11/13/2024	2,492	2,367,400	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.75%	05/29/2024	1,330	1,296,750	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	4.50%	05/29/2029	6,073	5,678,255	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.63%	06/03/2026	5,895	5,685,727	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.88%	11/22/2026	2,841	2,762,873	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.50%	01/16/2025	20,581	20,632,452	0.1
				<u>43,273,742</u>	<u>0.3</u>
<b>SONSTIGE FINANZWERTE</b>					
OEC Finance Ltd.(a)	4.38%	10/25/2029	3,166	129,797	0.0
OEC Finance Ltd.(a)	5.25%	12/27/2033	3,612	148,080	0.0
OEC Finance Ltd.(a)	7.13%	12/26/2046	34,251	1,329,992	0.0
				<u>1,607,869</u>	<u>0.0</u>
<b>REITS</b>					
Agile Group Holdings Ltd.	5.50%	05/17/2026	944	349,280	0.0
Central China Real Estate Ltd.	7.25%	04/24/2023	943	518,650	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Central China Real Estate Ltd.....	7.25%	07/16/2024	USD 1,354	\$ 609,300	0.0%
Central China Real Estate Ltd.....	7.25%	08/13/2024	3,686	1,658,700	0.0
Central China Real Estate Ltd.....	7.50%	07/14/2025	2,305	1,014,200	0.0
Central China Real Estate Ltd.....	7.75%	05/24/2024	3,475	1,563,750	0.0
Central China Real Estate Ltd.....	7.90%	11/07/2023	237	111,390	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(c).....	5.38%	09/13/2022	206	38,110	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(c).....	5.88%	03/01/2027	6,458	1,130,150	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(c).....	5.98%	08/18/2025	1,187	207,725	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(c).....	7.95%	02/19/2023	1,954	351,720	0.0
China Evergrande Group(c).....	7.50%	06/28/2023	2,122	307,690	0.0
China Evergrande Group(c).....	11.50%	01/22/2023	15,594	2,261,130	0.1
China Evergrande Group(c).....	12.00%	01/22/2024	905	131,225	0.0
China SCE Group Holdings Ltd.....	5.95%	09/29/2024	2,832	1,784,160	0.0
China SCE Group Holdings Ltd.....	6.00%	02/04/2026	3,014	1,687,840	0.0
China SCE Group Holdings Ltd.....	7.00%	05/02/2025	2,558	1,483,640	0.0
CIFI Holdings Group Co., Ltd.....	4.80%	05/17/2028	220	162,250	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(c).....	9.38%	06/30/2024	1,744	388,040	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(c).....	9.95%	07/23/2025	8,471	1,902,269	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(c).....	10.50%	01/15/2025	673	148,060	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(c).....	11.50%	01/30/2023	3,996	899,100	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(c).....	11.65%	06/01/2026	1,453	325,381	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(c).....	11.70%	11/11/2025	552	123,613	0.0
KWG Group Holdings Ltd.....	5.95%	08/10/2025	3,346	1,338,400	0.0
KWG Group Holdings Ltd.....	6.00%	08/14/2026	548	219,299	0.0
KWG Group Holdings Ltd.....	7.40%	01/13/2027	1,138	449,510	0.0
Logan Group Co., Ltd.....	4.50%	01/13/2028	234	65,520	0.0
Logan Group Co., Ltd.....	5.25%	10/19/2025	200	57,448	0.0
Logan Group Co., Ltd.....	5.75%	01/14/2025	210	62,296	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.....	4.90%	05/13/2026	869	391,050	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.....	5.95%	04/30/2025	788	378,240	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.....	6.25%	08/10/2024	738	391,140	0.0
Ronshine China Holdings Ltd.....	6.75%	08/05/2024	1,275	280,500	0.0
Ronshine China Holdings Ltd.....	7.10%	01/25/2025	7,341	1,578,315	0.0
Ronshine China Holdings Ltd.....	8.10%	06/09/2023	2,968	727,160	0.0
Scenery Journey Ltd.(c).....	11.50%	10/24/2022	9,136	867,920	0.0
Scenery Journey Ltd.(c).....	12.00%	10/24/2023	3,890	369,550	0.0
Seazen Group Ltd.....	4.45%	07/13/2025	2,790	1,478,700	0.0
Seazen Group Ltd.....	6.00%	08/12/2024	230	124,200	0.0
Shimao Group Holdings Ltd.....	5.20%	01/16/2027	600	168,000	0.0
Shimao Group Holdings Ltd.....	5.60%	07/15/2026	200	58,000	0.0
Sunac China Holdings Ltd.....	5.95%	04/26/2024	1,090	425,100	0.0
Sunac China Holdings Ltd.....	6.50%	01/10/2025	3,385	1,286,300	0.0
Sunac China Holdings Ltd.....	6.50%	01/26/2026	1,306	489,750	0.0
Sunac China Holdings Ltd.....	6.65%	08/03/2024	436	167,860	0.0
Sunac China Holdings Ltd.....	6.80%	10/20/2024	1,276	491,260	0.0
Sunac China Holdings Ltd.....	7.00%	07/09/2025	338	128,440	0.0
Times China Holdings Ltd.....	5.55%	06/04/2024	2,944	1,148,160	0.0
Times China Holdings Ltd.....	5.75%	01/14/2027	2,691	914,940	0.0
Times China Holdings Ltd.....	6.20%	03/22/2026	328	114,800	0.0
Times China Holdings Ltd.....	6.60%	03/02/2023	200	90,000	0.0
Times China Holdings Ltd.....	6.75%	07/08/2025	2,003	721,080	0.0
Trust Fibra Uno.....	4.87%	01/15/2030	23,243	22,908,882	0.2
Trust Fibra Uno.....	6.39%	01/15/2050	726	742,789	0.0
Trust Fibra Uno.....	6.95%	01/30/2044	3,173	3,464,123	0.1
Yango Justice International Ltd.....	7.50%	04/15/2024	1,669	211,546	0.0
Yango Justice International Ltd.....	7.50%	02/17/2025	8,149	1,059,370	0.0
Yango Justice International Ltd.....	7.88%	09/04/2024	4,671	607,230	0.0
Yango Justice International Ltd.....	8.25%	11/25/2023	1,088	141,440	0.0
Yango Justice International Ltd.....	9.25%	04/15/2023	200	26,000	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.....	6.35%	01/13/2027	5,192	830,720	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.....	7.38%	01/13/2026	1,008	175,014	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.....	7.70%	02/20/2025	218	34,880	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.....	7.85%	08/12/2026	3,334	533,440	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.....	8.38%	10/30/2024	957	153,120	0.0
Zhenro Properties Group Ltd.....	6.63%	01/07/2026	7,585	834,350	0.0
Zhenro Properties Group Ltd.....	6.70%	08/04/2026	365	40,150	0.0
Zhenro Properties Group Ltd.....	7.10%	09/10/2024	1,140	134,980	0.0
Zhenro Properties Group Ltd.....	7.35%	02/05/2025	1,109	121,990	0.0
				66,160,335	0.4
				132,719,134	0.8

VERSORGENSBETRIEBE

ELEKTRIZITÄT

AES Andes SA.....	6.35%	10/07/2079	10,186	10,198,733	0.1
AES El Salvador Trust II.....	6.75%	03/28/2023	5,470	5,108,638	0.0
Cemig Geracao e Transmissao SA.....	9.25%	12/05/2024	31,570	34,419,192	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
India Clean Energy Holdings . . . . .	4.50%	04/18/2027	USD 11,748	\$ 11,131,230	0.1%
JSW Hydro Energy Ltd. . . . .	4.13%	05/18/2031	386	356,085	0.0
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA . . . . .	4.38%	06/18/2026	14,120	13,375,876	0.1
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. . . . .	6.75%	04/24/2033	12,161	12,908,301	0.1
				<u>87,498,055</u>	<u>0.5</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE</b>					
<b>SENEGAL</b>					
Senegal Government International Bond . . . . .	6.25%	05/23/2033	53,439	49,297,477	0.3
Senegal Government International Bond . . . . .	6.75%	03/13/2048	30,851	26,007,393	0.1
				<u>75,304,870</u>	<u>0.4</u>
<b>QUASI-STAATSANLEIHEN</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
GUSAP III LP . . . . .	4.25%	01/21/2030	7,373	7,328,283	0.0
				<u>2,772,279,326</u>	<u>15.8</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Ally Financial, Inc. . . . .	8.00%	11/01/2031	29,736	38,992,639	0.3
Bank of America Corp., Series AA(d) . . . . .	6.10%	03/17/2025	14,150	14,857,500	0.1
Bank of America Corp., Series X(d) . . . . .	6.25%	09/05/2024	7,260	7,569,046	0.0
Bank of America Corp., Series DD(d) . . . . .	6.30%	03/10/2026	29,824	32,284,069	0.2
Bank of America Corp., Series Z(d) . . . . .	6.50%	10/23/2024	808	861,820	0.0
Bank of America Corp., Series B . . . . .	8.05%	06/15/2027	32,004	38,455,255	0.2
Barclays Bank PLC(d) . . . . .	6.86%	06/15/2032	1,667	2,137,240	0.0
Barclays PLC(d) . . . . .	7.13%	06/15/2025	GBP 13,922	19,390,605	0.1
Barclays PLC(d) . . . . .	7.25%	03/15/2023	5,167	7,065,172	0.0
BNP Paribas SA(d) . . . . .	6.75%	03/14/2022	USD 15,725	15,750,703	0.1
Citigroup, Inc.(d) . . . . .	3.88%	02/18/2026	8,826	8,394,014	0.1
Citigroup, Inc., Series W(d) . . . . .	4.00%	12/10/2025	7,221	6,943,234	0.0
Citigroup, Inc., Series Y(d) . . . . .	4.15%	11/15/2026	14,900	14,225,501	0.1
Citigroup, Inc., Series V(d) . . . . .	4.70%	01/30/2025	8,408	8,241,890	0.1
Citigroup, Inc.(d) . . . . .	5.95%	01/30/2023	33,515	34,162,052	0.2
Citigroup, Inc., Series T(d) . . . . .	6.25%	08/15/2026	5,672	6,119,032	0.0
Commerzbank AG . . . . .	8.13%	09/19/2023	1,629	1,752,431	0.0
Credit Agricole SA(d) . . . . .	8.13%	12/23/2025	14,131	15,932,702	0.1
Credit Agricole SA . . . . .	8.13%	03/23/2170	21,632	24,391,136	0.1
DNB Bank ASA(d) . . . . .	6.50%	03/26/2022	48,000	48,141,107	0.3
Dresdner Funding Trust I . . . . .	8.15%	06/30/2031	5,173	6,851,715	0.0
Erste Group Bank AG(d) . . . . .	6.50%	04/15/2024	EUR 10,600	12,393,968	0.1
First-Citizens Bank & Trust Co. . . . .	3.93%	06/19/2024	USD 6,749	6,880,346	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(d) . . . . .	5.00%	11/10/2022	39,485	37,912,884	0.2
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series O(d) . . . . .	5.30%	11/10/2026	3,702	3,852,243	0.0
HSBC Holdings PLC, Series E(d) . . . . .	4.75%	07/04/2029	EUR 9,250	10,530,303	0.1
HSBC Holdings PLC(d) . . . . .	6.00%	09/29/2023	6,504	7,646,829	0.1
HSBC Holdings PLC(d) . . . . .	6.38%	03/30/2025	USD 5,220	5,415,750	0.0
ING Groep NV(d) . . . . .	6.50%	04/16/2025	24,907	25,859,368	0.2
ING Groep NV(d) . . . . .	6.75%	04/16/2024	5,795	6,047,437	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series R(d) . . . . .	6.00%	08/01/2023	15,000	15,386,613	0.1
Lloyds Banking Group PLC . . . . .	3.37%	12/14/2046	4,061	3,542,876	0.0
Lloyds Banking Group PLC(d) . . . . .	7.50%	06/27/2024	6,268	6,655,620	0.0
Natwest Group PLC, Series U(d)(f) . . . . .	2.54%	03/31/2022	15,100	15,099,856	0.1
Regions Bank/Birmingham AL . . . . .	6.45%	06/26/2037	28,048	36,702,668	0.2
Skandinaviska Enskilda Banken AB(d) . . . . .	5.63%	05/13/2022	4,000	4,001,652	0.0
Standard Chartered PLC(d)(f) . . . . .	1.81%	01/30/2027	16,000	14,048,661	0.1
Standard Chartered PLC(d) . . . . .	7.75%	04/02/2023	13,945	14,489,227	0.1
Swedbank AB(d) . . . . .	6.00%	03/17/2022	5,800	5,801,966	0.0
UBS Group AG(d) . . . . .	7.00%	01/31/2024	49,607	51,591,280	0.3
UBS Group AG(d) . . . . .	7.00%	02/19/2025	32,133	34,181,479	0.2
				<u>670,559,889</u>	<u>3.8</u>
<b>MAKLER</b>					
Charles Schwab Corp. (The), Series G(d) . . . . .	5.38%	06/01/2025	26,176	27,636,218	0.2
<b>FINANZEN</b>					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust . . . . .	3.30%	01/30/2032	13,452	12,733,781	0.1
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust . . . . .	3.88%	01/23/2028	6,059	6,154,175	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust . . . . .	6.50%	07/15/2025	3,386	3,731,552	0.0
Aircastle Ltd. . . . .	2.85%	01/26/2028	5,211	4,975,626	0.0
Aircastle Ltd. . . . .	4.25%	06/15/2026	648	667,008	0.0
Aircastle Ltd. . . . .	5.25%	08/11/2025	42,255	44,795,543	0.3
Aviation Capital Group LLC . . . . .	1.95%	01/30/2026	1,558	1,483,471	0.0
Aviation Capital Group LLC . . . . .	3.50%	11/01/2027	5,788	5,720,840	0.0
Aviation Capital Group LLC . . . . .	4.13%	08/01/2025	7,715	7,922,853	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	USD 5,387	\$ 5,646,022	0.0%
				<u>93,830,871</u>	<u>0.5</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	39,949	49,927,805	0.3
Aon Corp.	8.21%	01/01/2027	13,915	16,696,839	0.1
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(f)	2.63%	02/12/2047	10,000	8,900,000	0.1
Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059	EUR 1,111	1,237,930	0.0
Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037	USD 36,487	48,463,393	0.3
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	7,000	8,872,432	0.1
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039	16,185	25,176,413	0.1
Nationwide Financial Services, Inc.	6.75%	05/15/2037	3,000	3,425,304	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co.(f)	2.49%	12/15/2024	5,000	4,998,900	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co.	9.38%	08/15/2039	22,662	37,217,402	0.2
Transatlantic Holdings, Inc.	8.00%	11/30/2039	14,148	20,977,095	0.1
				<u>225,893,513</u>	<u>1.3</u>
<b>SONSTIGE FINANZWERTE</b>					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	04/03/2026	1,974	2,061,723	0.0
<b>REITS</b>					
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	4.63%	08/01/2029	3,685	3,709,494	0.1
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.00%	10/15/2027	2,644	2,704,564	0.0
				<u>6,414,058</u>	<u>0.1</u>
				<u>1,026,396,272</u>	<u>5.9</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
ArcelorMittal SA	6.75%	03/01/2041	14,928	18,126,677	0.1
ArcelorMittal SA	7.00%	10/15/2039	11,517	14,183,498	0.1
Arconic Corp.	6.00%	05/15/2025	20,000	20,737,787	0.1
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043	20,942	22,572,613	0.1
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044	14,106	15,917,371	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.40%	11/14/2034	11,724	13,317,205	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.45%	03/15/2043	16,385	18,836,407	0.1
				<u>123,691,558</u>	<u>0.7</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
General Electric Co., Series D(d)(f)	3.53%	06/15/2022	30,828	29,278,249	0.2
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Netflix, Inc.	4.88%	06/15/2030	1,000	1,090,291	0.0
Netflix, Inc.	5.88%	11/15/2028	33,984	38,411,332	0.2
				<u>39,501,623</u>	<u>0.2</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
General Motors Co.	6.25%	10/02/2043	2,398	2,907,839	0.0
General Motors Co.	6.80%	10/01/2027	3,641	4,291,336	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.65%	01/17/2029	11,876	13,347,782	0.1
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030	12,304	12,364,852	0.1
				<u>32,911,809</u>	<u>0.2</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	31,126	33,637,923	0.2
Owens Corning	7.00%	12/01/2036	2,898	3,811,036	0.0
PulteGroup, Inc.	6.00%	02/15/2035	615	739,072	0.0
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	10,924	13,474,404	0.1
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	27,955	37,782,663	0.2
				<u>89,445,098</u>	<u>0.5</u>
<b>ENERGIE</b>					
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	5,144	6,453,525	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	19,163	21,372,024	0.1
Energy Transfer LP	6.25%	04/15/2049	1,000	1,167,478	0.0
Energy Transfer LP	8.25%	11/15/2029	8,521	10,968,308	0.1
Hess Corp.	7.30%	08/15/2031	2,953	3,760,620	0.0
Kinder Morgan, Inc., Series G	7.75%	01/15/2032	4,518	5,982,402	0.0
Kinder Morgan, Inc., Series G	7.80%	08/01/2031	18,933	25,019,235	0.2
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	6,690	7,133,590	0.1
Western Midstream Operating LP	3.60%	02/01/2025	12,908	12,938,589	0.1
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	4,301	4,348,908	0.0
Western Midstream Operating LP	4.00%	07/01/2022	5,337	5,338,895	0.0
Western Midstream Operating LP	4.50%	03/01/2028	13,423	13,893,642	0.1
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	3,831	3,976,896	0.0
Western Midstream Operating LP	5.45%	04/01/2044	5,469	5,608,373	0.0
				<u>127,962,485</u>	<u>0.7</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Dell International LLC/EMC Corp.....	8.35%	07/15/2046	USD 2,305	\$ 3,507,612	0.0%
Nokia Oyj.....	6.63%	05/15/2039	2,000	2,400,296	0.0
				<u>5,907,908</u>	<u>0.0</u>
<b>TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN</b>					
Delta Air Lines, Inc.....	7.00%	05/01/2025	27,353	30,371,109	0.2
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd. ....	4.75%	10/20/2028	17,879	18,570,917	0.1
Mileage Plus Holdings LLC/ Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd. ....	6.50%	06/20/2027	48,950	51,645,162	0.3
				<u>100,587,188</u>	<u>0.6</u>
				<u>549,285,918</u>	<u>3.1</u>
				<u>1,575,682,190</u>	<u>9.0</u>
<b>REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
U.S. Treasury Bonds(g) .....	1.38%	08/15/2050	179,875	147,553,711	0.8
U.S. Treasury Bonds(g) .....	6.00%	02/15/2026	172,260	200,521,872	1.2
U.S. Treasury Bonds(g) .....	6.13%	11/15/2027	62,738	77,472,001	0.5
U.S. Treasury Bonds(g) .....	6.25%	05/15/2030	83,300	111,400,739	0.6
U.S. Treasury Bonds .....	6.63%	02/15/2027	55,285	67,939,956	0.4
U.S. Treasury Bonds(g) .....	6.75%	08/15/2026	212,755	258,231,381	1.5
U.S. Treasury Notes(g) .....	0.38%	04/30/2025	5,100	4,899,984	0.0
U.S. Treasury Notes .....	0.63%	08/15/2030	200	181,281	0.0
U.S. Treasury Notes(g) .....	1.13%	02/15/2031	114,128	107,547,813	0.6
U.S. Treasury Notes(g) .....	1.38%	10/31/2028	237,834	231,144,919	1.3
				<u>1,206,893,657</u>	<u>6.9</u>
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-3A, Class M2(f) .....	2.94%	10/25/2028	14,474	14,324,193	0.1
Series 2019-4A, Class M2(f) .....	3.04%	10/25/2029	9,310	9,139,301	0.1
Series 2018-1A, Class B1(f) .....	4.44%	04/25/2028	3,894	3,856,633	0.0
Connecticut Avenue Securities Trust,					
Series 2018-R07, Class 1B1(f) .....	4.54%	04/25/2031	8,645	8,817,502	0.1
Eagle RE Ltd.					
Series 2019-1, Class M1B(f) .....	1.99%	04/25/2029	894	888,246	0.0
Series 2020-1, Class M2(f) .....	2.19%	01/25/2030	10,952	10,557,642	0.1
Series 2019-1, Class M2(f) .....	3.49%	04/25/2029	3,654	3,657,064	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp.,					
Series 2019-DNA1, Class B1(f) .....	4.84%	01/25/2049	3,365	3,433,037	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2019-FTR2, Class M2(f) .....	2.34%	11/25/2048	6,650	6,510,999	0.0
Series 2018-DNA2, Class B1(f) .....	3.89%	12/25/2030	5,829	5,878,961	0.0
Series 2014-DN3, Class M3(f) .....	4.19%	08/25/2024	951	961,007	0.0
Series 2017-DNA3, Class B1(f) .....	4.64%	03/25/2030	33,677	35,213,636	0.2
Series 2017-HQA3, Class B1(f) .....	4.64%	04/25/2030	4,415	4,590,647	0.0
Series 2017-HQA2, Class B1(f) .....	4.94%	12/25/2029	9,130	9,629,392	0.1
Series 2017-DNA2, Class B1(f) .....	5.34%	10/25/2029	24,511	26,378,058	0.2
Series 2015-DNA2, Class B(f) .....	7.74%	12/25/2027	48,155	50,370,943	0.3
Series 2015-HQ2, Class B(f) .....	8.14%	05/25/2025	1,424	1,442,023	0.0
Series 2016-DNA4, Class B(f) .....	8.79%	03/25/2029	8,694	9,156,592	0.1
Series 2016-HQA4, Class B(f) .....	8.94%	04/25/2029	2,293	2,434,228	0.0
Series 2015-HQA1, Class B(f) .....	8.99%	03/25/2028	19,291	20,262,407	0.1
Series 2015-DNA1, Class B(f) .....	9.39%	10/25/2027	32,013	36,016,624	0.2
Series 2015-DNA3, Class B(f) .....	9.54%	04/25/2028	15,263	16,704,098	0.1
Series 2015-HQA2, Class B(f) .....	10.69%	05/25/2028	10,435	11,607,924	0.1
Series 2015-HQ1, Class B(f) .....	10.94%	03/25/2025	6,668	6,784,101	0.0
Series 2016-DNA3, Class B(f) .....	11.44%	12/25/2028	7,232	8,388,865	0.0
Series 2015-DN1, Class B(f) .....	11.69%	01/25/2025	1,324	1,342,254	0.0
Series 2016-HQA2, Class B(f) .....	11.69%	11/25/2028	13,641	15,937,727	0.1
Series 2016-HQA1, Class B(f) .....	12.94%	09/25/2028	16,424	19,830,892	0.1
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2014-C03, Class 2M2(f) .....	3.09%	07/25/2024	406	409,411	0.0
Series 2018-C01, Class 1B1(f) .....	3.74%	07/25/2030	24,895	24,895,092	0.1
Series 2017-C05, Class 1B1(f) .....	3.79%	01/25/2030	11,946	12,070,144	0.1
Series 2017-C06, Class 1B1(f) .....	4.34%	02/25/2030	8,320	8,775,110	0.1
Series 2014-C01, Class M2(f) .....	4.59%	01/25/2024	1,415	1,471,239	0.0
Series 2017-C03, Class 1B1(f) .....	5.04%	10/25/2029	14,858	15,607,195	0.1
Series 2014-C04, Class 1M2(f) .....	5.09%	11/25/2024	16,184	16,768,795	0.1
Series 2015-C03, Class 1M2(f) .....	5.19%	07/25/2025	683	700,681	0.0
Series 2015-C03, Class 2M2(f) .....	5.19%	07/25/2025	69	69,334	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2017-C04, Class 2B1(f)	5.24%	11/25/2029	USD 4,454	\$ 4,764,139	0.0%
Series 2017-C02, Class 2B1(f)	5.69%	09/25/2029	1,584	1,706,785	0.0
Series 2015-C04, Class 1M2(f)	5.89%	04/25/2028	7,121	7,511,846	0.0
Series 2016-C01, Class 1M2(f)	6.94%	08/25/2028	15,990	16,762,510	0.1
Series 2016-C06, Class 1B(f)	9.44%	04/25/2029	21,185	22,970,540	0.1
Series 2016-C07, Class 2B(f)	9.69%	05/25/2029	27,684	29,781,958	0.2
Series 2016-C04, Class 1B(f)	10.44%	01/25/2029	46,155	50,517,634	0.3
Series 2016-C05, Class 2B(f)	11.24%	01/25/2029	36,055	38,831,127	0.2
Series 2016-C01, Class 1B(f)	11.94%	08/25/2028	39,194	43,388,618	0.2
Series 2016-C03, Class 1B(f)	11.94%	10/25/2028	7,786	8,796,997	0.1
Series 2016-C02, Class 1B(f)	12.44%	09/25/2028	21,442	24,363,924	0.1
Series 2016-C03, Class 2B(f)	12.94%	10/25/2028	18,476	21,623,599	0.1
Home Re Ltd., Series 2018-1, Class M2(f)	3.19%	10/25/2028	14,423	14,358,072	0.1
Oaktown Re III Ltd., Series 2019-1A, Class M2(f)	2.74%	07/25/2029	2,222	2,182,451	0.0
Radnor Re Ltd.					
Series 2019-2, Class M1B(f)	1.94%	06/25/2029	356	355,105	0.0
Series 2020-1, Class M2A(f)	2.19%	01/25/2030	11,179	10,756,085	0.1
Series 2020-1, Class M2B(f)	2.44%	01/25/2030	9,514	9,154,663	0.1
Series 2018-1, Class M2(f)	2.89%	03/25/2028	2,721	2,711,477	0.0
Series 2019-1, Class M2(f)	3.39%	02/25/2029	2,254	2,239,454	0.0
Traingle Re Ltd., Series 2020-1, Class M2(f)	5.79%	10/25/2030	7,900	8,047,873	0.0
				<u>745,706,854</u>	<u>4.2</u>

FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE

Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs

Series 5011, Class MI(h)	3.00%	09/25/2050	11,534	1,823,321	0.0
Series 5008, Class AI(h)	3.50%	09/25/2050	12,014	1,871,328	0.0
Series 5030, Class EI(h)	3.50%	10/25/2050	4,494	854,474	0.0
Series 5040, Class AI(h)	3.50%	11/25/2050	1,712	283,925	0.0
Series 5049, Class CI(h)	3.50%	12/25/2050	20,611	2,973,883	0.0
Series 5036, Class IT(h)	4.00%	03/25/2050	6,055	982,643	0.0
Series 5015, Class BI(h)	4.00%	09/25/2050	20,240	3,356,588	0.0
Series 5013, Class JI(h)	4.00%	09/25/2050	21,141	2,839,440	0.0
Series 5018, Class AI(h)	4.00%	10/25/2050	11,002	1,931,758	0.0
Series 5024, Class DI(h)	4.00%	10/25/2050	4,791	782,380	0.0
Series 5040, Class CI(h)	4.00%	11/25/2050	21,385	3,198,476	0.0
Series 5052, Class IK(h)	4.00%	12/25/2050	18,369	3,028,921	0.0
Series 4976, Class MI(h)	4.50%	05/25/2050	26,592	4,879,625	0.1
Series 4987, Class IC(h)	4.50%	06/25/2050	95,523	14,688,976	0.1
Series 5018, Class GI(h)	4.50%	10/25/2050	14,781	2,392,837	0.0
Series 4981, Class MI(h)	5.00%	06/25/2050	42,989	8,111,429	0.1
Series 4993, Class LI(h)	5.00%	07/25/2050	11,890	1,779,454	0.0
Series 5043, Class IO(h)	5.00%	11/25/2050	13,057	2,644,110	0.0
Series 4398, Class IO(h)	6.00%	10/15/2037	23,384	4,721,864	0.1

Federal National Mortgage Association REMICs

Series 2020-96, Class KI(h)	2.50%	01/25/2051	5,945	758,103	0.0
Series 2021-18, Class IT(h)	3.00%	04/25/2051	12,112	1,647,710	0.0
Series 2020-76, Class GI(h)	4.00%	11/25/2050	13,465	1,922,458	0.0
Series 2020-89, Class KI(h)	4.00%	12/25/2050	61,271	9,419,696	0.1
Series 2015-49, Class LI(h)	5.00%	07/25/2045	12,456	2,024,673	0.0
Series 2016-26, Class IO(h)	5.00%	05/25/2046	12,713	2,129,240	0.0
Series 2010-109, Class IQ(h)	5.50%	08/25/2040	4,741	515,443	0.0
Series 2019-4, Class AI(h)	6.00%	08/25/2038	21,727	4,281,765	0.0
Series 2013-66, Class LI(h)	7.00%	07/25/2043	13,219	2,546,643	0.0

Government National Mortgage Association,

Series 2021-41, Class UI(h)	3.50%	03/20/2051	23,770	3,212,467	0.0
				<u>91,603,630</u>	<u>0.5</u>

VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE

Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs

Series 4248, Class SL(f)(i)	5.86%	05/15/2041	17,321	2,532,044	0.0
Series 4954, Class SL(f)(i)	5.86%	02/25/2050	20,033	3,414,030	0.0
Series 4981, Class HS(f)(i)	5.91%	06/25/2050	62,504	9,997,557	0.1
Series 4981, Class JS(f)(i)	5.91%	06/25/2050	98,728	17,778,949	0.1
Series 4701, Class NS(f)(i)	5.96%	08/15/2039	6,679	1,221,178	0.0
Series 4125, Class SA(f)(i)	5.96%	11/15/2042	5,730	1,023,540	0.0
Series 4736, Class LS(f)(i)	6.01%	12/15/2047	24,687	5,062,055	0.1
Series 4736, Class SM(f)(i)	6.01%	12/15/2047	50,217	9,495,339	0.1
Series 4774, Class BS(f)(i)	6.01%	02/15/2048	24,050	4,097,076	0.0

Federal National Mortgage Association REMICs

Series 2012-70, Class HS(f)(i)	5.81%	07/25/2042	3,493	632,089	0.0
Series 2016-64, Class SP(f)(i)	5.81%	09/25/2046	17,796	3,203,114	0.0
Series 2016-89, Class SH(f)(i)	5.81%	12/25/2046	12,713	2,312,102	0.0
Series 2019-38, Class SM(f)(i)	5.86%	07/25/2049	4,956	1,042,623	0.0



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2019-65, Class SY(f)(i) .....	5.86%	11/25/2049	USD 10,374	\$ 2,010,008	0.0%
Series 2013-15, Class SA(f)(i) .....	5.96%	03/25/2043	15,409	2,982,623	0.0
Series 2017-97, Class SW(f)(i) .....	6.01%	12/25/2047	28,924	5,656,762	0.1
Series 2018-43, Class SB(f)(i) .....	6.01%	06/25/2048	7,182	1,267,140	0.0
Series 2018-36, Class SG(f)(i) .....	6.01%	06/25/2048	12,640	2,550,304	0.0
Series 2015-26, Class SH(f)(i) .....	6.26%	05/25/2045	4,883	995,403	0.0
Series 2005-91, Class SD(f)(i) .....	6.51%	10/25/2035	5,287	916,844	0.0
<b>Government National Mortgage Association</b>					
Series 2015-3, Class DS(f)(i) .....	5.44%	11/20/2041	15,942	871,440	0.0
Series 2020-47, Class SG(f)(i) .....	5.84%	02/20/2049	11,739	1,836,222	0.0
Series 2009-76, Class SB(f)(i) .....	5.97%	09/16/2039	6,297	978,709	0.0
Series 2017-134, Class MS(f)(i) .....	6.04%	09/20/2047	6,751	1,132,117	0.0
Series 2017-161, Class CS(f)(i) .....	6.09%	10/20/2047	13,875	2,258,513	0.0
				<u>85,267,781</u>	<u>0.5</u>
<b>NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH</b>					
<b>Alternative Loan Trust</b>					
Series 2006-24CB, Class A16 .....	5.75%	08/25/2036	1,465	1,070,192	0.0
Series 2007-15CB, Class A19 .....	5.75%	07/25/2037	1,495	1,163,402	0.0
Series 2006-28CB, Class A18 .....	6.00%	10/25/2036	838	565,590	0.0
Series 2007-16CB, Class 1A7 .....	6.00%	08/25/2037	3,227	3,005,868	0.0
Series 2006-42, Class A6 .....	6.00%	01/25/2047	2,696	2,004,388	0.0
Series 2006-26CB, Class A6 .....	6.25%	09/25/2036	671	450,731	0.0
Series 2006-26CB, Class A8 .....	6.25%	09/25/2036	2,539	1,705,458	0.0
Series 2006-28CB, Class A14 .....	6.25%	10/25/2036	2,379	1,652,824	0.0
Series 2006-J5, Class 1A1 .....	6.50%	09/25/2036	1,837	1,398,175	0.0
<b>Bear Stearns ARM Trust,</b>					
Series 2007-4, Class 22A1 .....	3.25%	06/25/2047	6,610	6,563,278	0.1
<b>ChaseFlex Trust,</b>					
Series 2007-1, Class 1A3 .....	6.50%	02/25/2037	4,392	2,197,773	0.0
<b>CHL Mortgage Pass-Through Trust</b>					
Series 2007-HY4, Class 1A1 .....	2.93%	09/25/2047	1,838	1,750,476	0.0
Series 2007-3, Class A30 .....	5.75%	04/25/2037	1,195	766,737	0.0
<b>Citigroup Mortgage Loan Trust,</b>					
Series 2007-AR4, Class 1A1A .....	3.17%	03/25/2037	1,131	1,123,833	0.0
<b>CitiMortgage Alternative Loan Trust,</b>					
Series 2007-A3, Class 1A4 .....	5.75%	03/25/2037	506	500,260	0.0
<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust,</b>					
Series 2006-13, Class 1A19 .....	6.25%	09/25/2036	603	366,965	0.0
<b>First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust,</b>					
Series 2006-AA3, Class A1 .....	2.54%	06/25/2036	1,655	1,481,655	0.0
<b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust,</b>					
Series 2007-6XS, Class 2A5S .....	6.00%	02/25/2047	3,941	1,996,579	0.0
<b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>					
Series 2005-QA10, Class A31 .....	3.81%	09/25/2035	3,843	3,233,965	0.1
Series 2005-QS14, Class 3A1 .....	6.00%	09/25/2035	931	916,118	0.0
<b>Residential Asset Securitization Trust</b>					
Series 2006-A8, Class 3A4 .....	6.00%	08/25/2036	2,369	1,571,702	0.0
Series 2007-A1, Class A8 .....	6.00%	03/25/2037	3,830	1,884,567	0.0
Series 2007-A5, Class 2A3 .....	6.00%	05/25/2037	1,045	786,978	0.0
<b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust,</b>					
Series 2006-3, Class 3CB4 .....	6.00%	04/25/2036	451	445,336	0.0
				<u>38,602,850</u>	<u>0.2</u>
<b>NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH</b>					
<b>Alternative Loan Trust, Series 2007-7T2, Class A3(f) .....</b>					
	0.79%	04/25/2037	6,421	1,903,128	0.0
<b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust,</b>					
Series 2007-13, Class A7(f) .....	0.79%	08/25/2037	2,200	878,931	0.0
<b>First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust,</b>					
Series 2007-FA2, Class 1A6(f)(i) .....	5.36%	04/25/2037	1,649	369,855	0.0
<b>Impac Secured Assets Corp.,</b>					
Series 2005-2, Class A2D(f) .....	1.05%	03/25/2036	1,360	1,243,361	0.0
<b>Lehman XS Trust</b>					
Series 2007-16N, Class 2A2(f) .....	1.04%	09/25/2047	1,911	1,955,868	0.1
Series 2007-10H, Class 2AIO(f)(i) .....	6.89%	07/25/2037	2,999	466,219	0.0
<b>PHH Alternative Mortgage Trust,</b>					
Series 2007-2, Class 1A3(f) .....	0.85%	05/25/2037	1,271	1,252,587	0.0
<b>RBSGC Mortgage Loan Trust,</b>					
Series 2007-B, Class 1A4(f) .....	0.64%	01/25/2037	909	341,264	0.0
<b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust,</b>					
Series 2006-QS18, Class 2A2(f)(i) .....	6.36%	12/25/2036	6,474	947,180	0.0
				<u>9,358,393</u>	<u>0.1</u>
				<u>970,539,508</u>	<u>5.5</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>INVESTMENTGESELLSCHAFTEN</b>					
<b>FONDS UND INVESTMENTTRUSTS</b>					
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT . . .			2,002,791	\$ 187,080,696	1.1%
AB SICAV I - Emerging Market Corporate Debt Portfolio - Class S . . . . .			4,017,647	103,012,468	0.6
AB SICAV I - Emerging Market Local Currency Debt Portfolio - Class ZT . . . . .			4,441,642	45,748,908	0.2
AB SICAV I - Euro High Yield Portfolio - Class S . . . . .			5,216,996	182,389,180	1.0
AB SICAV I - Financial Credit Portfolio - Class ZT . . . . .			1,297,938	141,423,282	0.8
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT . . . . .			4,445,135	64,454,454	0.4
				<u>724,108,988</u>	<u>4.1</u>
<b>QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE</b>					
<b>QUASI-STAAATSANLEIHEN</b>					
<b>BAHRAIN</b>					
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The) . . . . .	7.50%	10/25/2027	USD 4,456	<u>4,623,100</u>	<u>0.0</u>
<b>INDONESIEN</b>					
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT . . . . .	4.75%	05/15/2025	1,131	1,153,744	0.0
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT . . . . .	5.45%	05/15/2030	1,209	<u>1,275,722</u>	<u>0.0</u>
				<u>2,429,466</u>	<u>0.0</u>
<b>MEXIKO</b>					
Comision Federal de Electricidad . . . . .	4.69%	05/15/2029	11,134	11,147,917	0.1
Petroleos Mexicanos . . . . .	5.95%	01/28/2031	90,503	84,163,265	0.5
Petroleos Mexicanos . . . . .	6.70%	02/16/2032	19,401	18,624,960	0.1
Petroleos Mexicanos . . . . .	6.75%	09/21/2047	45,907	37,799,824	0.2
Petroleos Mexicanos . . . . .	6.95%	01/28/2060	23,631	<u>19,509,754</u>	<u>0.1</u>
				<u>171,245,720</u>	<u>1.0</u>
<b>PANAMA</b>					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA . . . . .	4.00%	08/11/2041	3,367	3,081,437	0.1
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA . . . . .	5.13%	08/11/2061	2,883	<u>2,613,259</u>	<u>0.0</u>
				<u>5,694,696</u>	<u>0.1</u>
<b>SÜDAFRIKA</b>					
Eskom Holdings SOC Ltd. . . . .	4.31%	07/23/2027	4,162	3,891,470	0.0
Eskom Holdings SOC Ltd. . . . .	6.35%	08/10/2028	7,156	7,272,285	0.0
Eskom Holdings SOC Ltd. . . . .	7.13%	02/11/2025	7,482	7,324,410	0.1
Transnet SOC Ltd. . . . .	4.00%	07/26/2022	1,939	<u>1,919,610</u>	<u>0.0</u>
				<u>20,407,775</u>	<u>0.1</u>
<b>TRINIDAD &amp; TOBAGO</b>					
Trinidad Generation UnLtd. . . . .	5.25%	11/04/2027	441	<u>443,205</u>	<u>0.0</u>
<b>UKRAINE</b>					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC . . . . .	7.38%	07/19/2022	10,054	3,016,200	0.0
State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC . . . . .	9.63%	03/20/2025	3,289	<u>1,480,027</u>	<u>0.0</u>
				<u>4,496,227</u>	<u>0.0</u>
<b>VENEZUELA</b>					
Petroleos de Venezuela SA(c) . . . . .	5.38%	04/12/2027	61,738	<u>2,315,168</u>	<u>0.0</u>
				<u>211,655,357</u>	<u>1.2</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>BAHRAIN</b>					
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The) . . . . .	7.63%	11/07/2024	17,099	17,868,455	0.1
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The) . . . . .	8.38%	11/07/2028	14,848	<u>16,068,505</u>	<u>0.1</u>
				<u>33,936,960</u>	<u>0.2</u>
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>					
DP World Crescent Ltd. . . . .	3.88%	07/18/2029	899	918,553	0.0
DP World Ltd./United Arab Emirates . . . . .	5.63%	09/25/2048	3,782	4,221,658	0.0
DP World Salaam(d) . . . . .	6.00%	10/01/2025	21,915	<u>22,887,478</u>	<u>0.1</u>
				<u>28,027,689</u>	<u>0.1</u>
				<u>61,964,649</u>	<u>0.3</u>
<b>STAATSANLEIHEN</b>					
<b>UKRAINE</b>					
State Agency of Roads of Ukraine . . . . .	6.25%	06/24/2028	35,107	<u>10,532,100</u>	<u>0.1</u>
				<u>284,152,106</u>	<u>1.6</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Consolidated Energy Finance SA . . . . .	5.00%	10/15/2028	EUR 6,188	6,385,701	0.1
Consolidated Energy Finance SA . . . . .	6.50%	05/15/2026	USD 5,585	<u>5,586,864</u>	<u>0.0</u>
				<u>11,972,565</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Melco Resorts Finance Ltd. ....	5.38%	12/04/2029	USD 1,875	\$ 1,621,125	0.0%
Melco Resorts Finance Ltd. ....	5.63%	07/17/2027	10,154	9,447,536	0.1
MGM China Holdings Ltd. ....	5.25%	06/18/2025	5,982	5,672,805	0.0
MGM China Holdings Ltd. ....	5.38%	05/15/2024	8,461	8,187,604	0.0
MGM China Holdings Ltd. ....	5.88%	05/15/2026	6,242	5,962,280	0.0
Studio City Co., Ltd. ....	7.00%	02/15/2027	3,664	3,615,635	0.0
Studio City Finance Ltd. ....	5.00%	01/15/2029	2,548	1,970,400	0.0
Studio City Finance Ltd. ....	6.00%	07/15/2025	9,535	8,818,683	0.1
Studio City Finance Ltd. ....	6.50%	01/15/2028	10,680	9,345,000	0.1
Wynn Macau Ltd. ....	4.88%	10/01/2024	1,000	923,938	0.0
Wynn Macau Ltd. ....	5.13%	12/15/2029	3,667	3,098,615	0.0
Wynn Macau Ltd. ....	5.50%	01/15/2026	16,527	14,963,546	0.1
Wynn Macau Ltd. ....	5.50%	10/01/2027	12,252	10,650,664	0.1
Wynn Macau Ltd. ....	5.63%	08/26/2028	10,091	8,701,469	0.0
				<u>92,979,300</u>	<u>0.5</u>
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV ....	4.75%	05/09/2027	20,440	19,469,100	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV ....	5.13%	05/09/2029	20,440	19,468,845	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV ....	7.13%	01/31/2025	21,515	22,590,750	0.1
				<u>61,528,695</u>	<u>0.3</u>
<b>ENERGIE</b>					
Leviathan Bond Ltd. ....	5.75%	06/30/2023	7,973	8,000,906	0.1
Leviathan Bond Ltd. ....	6.13%	06/30/2025	7,639	7,743,371	0.0
Leviathan Bond Ltd. ....	6.50%	06/30/2027	13,968	14,222,266	0.1
				<u>29,966,543</u>	<u>0.2</u>
				<u>196,447,103</u>	<u>1.1</u>
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd./ Highlands Holdings Bond Co-Issuer, Inc.(a) ....	7.63%	10/15/2025	7,602	7,830,547	0.1
				<u>204,277,650</u>	<u>1.2</u>
<b>STAMMAKTIEN</b>					
Avaya Holdings Corp. ....			377,239	5,194,581	0.0
Berry Corp. ....			2,589,382	25,893,820	0.2
Civitas Resources, Inc. ....			90,161	4,550,426	0.0
Denbury, Inc. ....			286,004	20,781,051	0.1
Gulfport Energy Operating Corp. ....			853,777	58,893,537	0.3
iHeartMedia, Inc. - Class A ....			542,779	11,642,609	0.1
SandRidge Energy, Inc. ....			3,888	51,983	0.0
Whiting Petroleum Corp. ....			207,753	15,342,559	0.1
WillScot Mobile Mini Holdings Corp. ....			323,192	11,483,012	0.1
				<u>153,833,578</u>	<u>0.9</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE</b>					
<b>BAHRAIN</b>					
Bahrain Government International Bond. ....	5.45%	09/16/2032	USD 2,327	2,140,840	0.0
Bahrain Government International Bond. ....	5.63%	09/30/2031	28,000	26,369,000	0.2
Bahrain Government International Bond. ....	6.75%	09/20/2029	17,385	17,806,586	0.1
Bahrain Government International Bond. ....	7.00%	10/12/2028	36,120	38,196,900	0.2
Bahrain Government International Bond. ....	7.38%	05/14/2030	6,009	6,365,033	0.0
CBB International Sukuk Programme Co. WLL. ....	6.25%	11/14/2024	6,455	6,839,476	0.1
				<u>97,717,835</u>	<u>0.6</u>
<b>OMAN</b>					
Oman Government International Bond ....	4.13%	01/17/2023	7,000	7,035,000	0.1
Oman Government International Bond ....	4.75%	06/15/2026	7,017	6,999,458	0.0
Oman Government International Bond ....	6.25%	01/25/2031	32,548	33,605,810	0.2
Oman Government International Bond ....	7.00%	01/25/2051	4,424	4,357,640	0.0
				<u>51,997,908</u>	<u>0.3</u>
				<u>149,715,743</u>	<u>0.9</u>
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>					
<b>NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS</b>					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E. ....	4.65%	02/10/2036	11,700	11,460,070	0.1
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(h) ....	0.99%	11/15/2050	5,649	209,538	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C8, Class XA(h) ....	1.49%	06/15/2050	7,972	490,127	0.0
Citigroup Commercial Mortgage Trust Series 2018-C6, Class XA(h) ....	0.77%	11/10/2051	3,175	142,734	0.0
Series 2017-P8, Class XA(h) ....	0.89%	09/15/2050	46,628	1,901,570	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2015-GC29, Class XA(h) . . . . .	1.02%	04/10/2048	USD 28,252	\$ 753,969	0.0%
Series 2013-GC11, Class XA(h) . . . . .	1.35%	04/10/2046	22,800	252,339	0.0
Series 2014-GC23, Class D . . . . .	4.48%	07/10/2047	15,574	15,159,216	0.1
<b>Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2014-CR15, Class XA(h) . . . . .	0.65%	02/10/2047	41,527	487,607	0.0
Series 2016-DC2, Class XA(h) . . . . .	0.95%	02/10/2049	35,398	1,097,534	0.0
Series 2014-CR20, Class XA(h) . . . . .	0.98%	11/10/2047	47,524	1,001,915	0.0
Series 2017-COR2, Class XA(h) . . . . .	1.16%	09/10/2050	17,855	956,788	0.0
Series 2013-LC6, Class XA(h) . . . . .	1.26%	01/10/2046	35,725	186,094	0.0
Series 2012-CR5, Class XA(h) . . . . .	1.49%	12/10/2045	48,213	303,522	0.0
Series 2012-CR3, Class XA(h) . . . . .	1.83%	10/15/2045	62,198	215,852	0.0
Series 2010-C1, Class F . . . . .	4.00%	07/10/2046	3,049	2,521,275	0.0
Series 2012-CR2, Class G . . . . .	4.25%	08/15/2045	4,120	2,273,828	0.0
Series 2012-CR3, Class F . . . . .	4.75%	10/15/2045	3,626	909,023	0.0
Series 2014-CR16, Class D . . . . .	4.92%	04/10/2047	20,000	18,759,714	0.1
<b>GS Mortgage Securities Trust</b>					
Series 2017-GS7, Class XA(h) . . . . .	1.11%	08/10/2050	57,378	2,568,623	0.0
Series 2014-GC18, Class D . . . . .	5.05%	01/10/2047	2,748	1,209,267	0.0
Series 2011-GC5, Class D . . . . .	5.16%	08/10/2044	2,801	1,295,539	0.0
<b>JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust</b>					
Series 2014-C21, Class XA(h) . . . . .	0.96%	08/15/2047	58,653	1,042,609	0.0
Series 2013-C15, Class XA(h) . . . . .	1.02%	11/15/2045	29,042	372,825	0.0
Series 2013-C14, Class D . . . . .	4.55%	08/15/2046	3,001	1,926,219	0.0
<b>Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust</b>					
Series 2015-C22, Class XA(h) . . . . .	1.02%	04/15/2048	66,846	1,575,878	0.0
Series 2016-C30, Class XA(h) . . . . .	1.36%	09/15/2049	58,079	2,880,249	0.0
Series 2012-C6, Class XA(h) . . . . .	1.59%	11/15/2045	33,511	63,607	0.0
<b>Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2016-BNK2, Class XA(h)</b>					
<b>UBS Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2018-C15, Class XA(h) . . . . .	0.90%	12/15/2051	96,600	4,681,329	0.1
Series 2018-C10, Class XA(h) . . . . .	0.93%	05/15/2051	84,714	3,912,838	0.0
Series 2018-C14, Class XA(h) . . . . .	0.98%	12/15/2051	49,112	2,676,109	0.0
Series 2017-C2, Class XA(h) . . . . .	1.05%	08/15/2050	3,044	128,086	0.0
<b>Wells Fargo Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2018-C48, Class XA(h) . . . . .	0.95%	01/15/2052	30,179	1,667,915	0.0
Series 2017-C38, Class XA(h) . . . . .	1.01%	07/15/2050	25,901	1,062,965	0.0
Series 2016-C33, Class XA(h) . . . . .	1.61%	03/15/2059	58,811	3,181,927	0.0
Series 2016-LC24, Class XA(h) . . . . .	1.62%	10/15/2049	86,861	5,095,725	0.1
Series 2016-C35, Class XA(h) . . . . .	1.89%	07/15/2048	5,030	331,850	0.0
<b>WF-RBS Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2013-C11, Class XA(h) . . . . .	1.13%	03/15/2045	63,334	342,518	0.0
Series 2012-C7, Class XA(h) . . . . .	1.18%	06/15/2045	12,980	1,290	0.0
Series 2012-C10, Class XA(h) . . . . .	1.48%	12/15/2045	88,932	619,298	0.0
Series 2012-C8, Class XA(h) . . . . .	1.69%	08/15/2045	18,356	20,619	0.0
Series 2014-C20, Class D . . . . .	3.99%	05/15/2047	4,799	1,984,160	0.0
Series 2012-C8, Class F . . . . .	4.85%	08/15/2045	8,767	8,469,705	0.1
				<u>109,049,875</u>	<u>0.6</u>
<b>NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS</b>					
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class E(f) . . . . .	4.94%	05/15/2036	5,780	4,193,694	0.0
				<u>113,243,569</u>	<u>0.6</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
HDFC Bank Ltd. . . . .	8.10%	03/22/2025	INR 1,070,000	14,351,754	0.1
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>ENERGIE</b>					
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Series E . . . . .	7.13%	10/10/2022	2,500,000	33,229,371	0.2
<b>STAATSANLEIHEN</b>					
<b>ÄGYPTEN</b>					
Egypt Government Bond, Series 5YR . . . . .	14.06%	01/12/2026	EGP 419,000	26,396,341	0.1
<b>SCHATZOBIGATIONEN</b>					
<b>INDONESIEN</b>					
Indonesia Government International Bond . . . . .	9.50%	05/17/2041	IDR 414,814,000	35,441,232	0.2
				<u>109,418,698</u>	<u>0.6</u>
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>CLO – VARIABLE VERZINSLICH</b>					
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class E(f) . . . . .	6.24%	04/15/2034	USD 5,000	4,845,350	0.0
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class E(f) . . . . .	6.60%	04/15/2034	4,063	3,946,044	0.0
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class E(f) . . . . .	6.40%	07/20/2034	2,500	2,408,483	0.0
AGL CLO 13 Ltd., Series 2021-13A, Class E(f) . . . . .	6.66%	10/20/2034	12,156	11,785,423	0.1

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
AGL CLO 16 Ltd., Series 2021-16A, Class E(f) . . . . .	7.10%	01/20/2035	USD 2,900	\$ 2,815,242	0.0%
AIG CLO Ltd., Series 2021-3A, Class E(f) . . . . .	6.57%	01/25/2035	7,600	7,345,962	0.1
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class E(f) . . . . .	6.00%	04/20/2034	3,000	2,874,003	0.0
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class D(f) . . . . .	7.25%	01/20/2034	1,750	1,705,139	0.0
Ballyrock CLO 17 Ltd., Series 2021-17A, Class D(f) . . . . .	6.12%	10/20/2034	5,030	4,791,155	0.0
Benefit Street Partners CLO XXII Ltd, Series 2020-22A, Class E(f) . . . . .	7.25%	01/20/2032	1,188	1,157,242	0.0
Cedar Funding IX CLO Ltd., Series 2018-9A, Class E(f) . . . . .	5.60%	04/20/2031	550	518,636	0.0
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(f) . . . . .	6.54%	07/18/2030	3,732	3,633,330	0.0
Dryden 57 CLO Ltd., Series 2018-57A, Class E(f) . . . . .	5.71%	05/15/2031	6,004	5,615,907	0.1
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(f) . . . . .	6.70%	04/15/2034	3,600	3,453,268	0.0
Jamestown CLO XI Ltd., Series 2018-11A, Class D(f) . . . . .	6.26%	07/14/2031	1,250	1,143,170	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-42A, Class E(f) . . . . .	6.19%	07/16/2035	2,750	2,689,987	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class ER(f) . . . . .	6.49%	10/16/2033	8,200	7,993,967	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class E(f) . . . . .	7.45%	01/20/2032	2,250	2,186,327	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 44 Ltd., Series 2021-44A, Class E(f) . . . . .	6.24%	10/16/2034	750	732,916	0.0
OZLM XXII Ltd., Series 2018-22A, Class D(f) . . . . .	5.54%	01/17/2031	2,933	2,582,730	0.0
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(f) . . . . .	6.25%	10/20/2034	3,700	3,586,121	0.0
PPM CLO 5 Ltd., Series 2021-5A, Class E(f) . . . . .	6.62%	10/18/2034	2,050	1,975,745	0.0
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(f) . . . . .	6.19%	07/15/2031	7,200	6,590,621	0.1
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(f) . . . . .	6.61%	07/20/2034	2,000	1,894,940	0.0
Wehpk, Series 2022-1A, Class E(f) . . . . .	0.00%	04/21/2035	11,890	11,890,000	0.1
				<u>100,161,708</u>	<u>0.6</u>
<b>VORZUGSAKTIEN</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Hartford Financial Services Group, Inc. (The) . . . . .	7.88%		655,525	<u>16,604,448</u>	<u>0.1</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>ENERGIE</b>					
Targa Resources Corp., Series A . . . . .	9.50%		20,939	<u>22,641,414</u>	<u>0.1</u>
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
Vistra Energy Corp.(d) . . . . .	0.00%		454,387	<u>590,703</u>	<u>0.0</u>
				<u>39,836,565</u>	<u>0.2</u>
<b>OPTIONSSCHEINE</b>					
Avaya Holdings Corp., expiring 12/15/2022 . . . . .			750,462	<u>2,243,881</u>	<u>0.0</u>
				<u>16,769,302,498</u>	<u>95.5</u>
<b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>					
<b>REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE</b>					
<b>ÄGYPTEN</b>					
Egypt Treasury Bills . . . . .	0.00%	04/12/2022	EGP 625,000	<u>39,247,295</u>	<u>0.2</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>REITS</b>					
Agile Group Holdings Ltd. . . . .	4.85%	08/31/2022	USD 3,992	2,268,703	0.0
Yango Justice International Ltd. . . . .	10.25%	09/15/2022	628	<u>81,640</u>	<u>0.0</u>
				<u>2,350,343</u>	<u>0.0</u>
				<u>41,597,638</u>	<u>0.2</u>
				<u>16,810,900,136</u>	<u>95.7</u>
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>STAMMAKTIEN</b>					
Southeastern Grocers, Inc.(j) . . . . .			2,258,161	51,937,703	0.3
ATD New Holdings, Inc. . . . .			525,684	43,719,561	0.3
Mt. Logan Re Ltd.(j) . . . . .			22,043	20,747,652	0.1
Carlson Travel, Inc. . . . .			542,258	17,284,474	0.1
Diamond Offshore Drilling, Inc. . . . .			3,002,103	15,010,515	0.1
Mt. Logan Re Ltd. (Series 1) (Preference Shares)(j) . . . . .			14,500	14,535,218	0.1
Exide Corp.(j) . . . . .			6,006	7,957,950	0.0
Paysafe Ltd. . . . .			1,617,484	5,159,774	0.0
Vantage Drilling International . . . . .			266,094	1,596,564	0.0
Monitronics International, Inc. . . . .			812,814	2,032,035	0.0
Battalion Oil Corp. . . . .			393	7,310	0.0
K201640219 South Africa Ltd. A Shares(j) . . . . .			193,371,375	193	0.0
CHC Group LLC(j) . . . . .			262,557	53	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %	
K201640219 South Africa Ltd. B Shares(j) . . . . .			30,622,211	\$ 31	0.0%	
BIS Industries Holdings Ltd.(j) . . . . .			10,224,003	10	0.0	
Ag Tracker(j) . . . . .			1,148,905	1	0.0	
Neenah Enterprises, Inc.(j) . . . . .			504,400	1	0.0	
Golo Mobile, Inc.(j) . . . . .			485,119	0	0.0	
New Cotai LLC/New Cotai Capital Corp.(j) . . . . .			63	0	0.0	
				<u>179,989,045</u>	<u>1.0</u>	
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT</b>						
<b>INDUSTRIE</b>						
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG</b>						
Royal Caribbean Cruises Ltd. . . . .	5.50%	08/31/2026	USD	18,015	17,895,741	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd. . . . .	11.50%	06/01/2025		28,450	31,322,027	0.1
					<u>49,217,768</u>	<u>0.2</u>
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>						
Sunshine Mid BV . . . . .	6.50%	05/15/2026	EUR	18,558	20,910,511	0.1
<b>GRUNDSTOFFE</b>						
Intelligent Packaging Holdco Issuer LP(a) . . . . .	9.00%	01/15/2026	USD	12,133	12,296,864	0.1
Magnetation LLC/Mag Finance Corp.(j)(k) . . . . .	11.00%	05/15/2018		40,106	0	0.0
SCIH Salt Holdings, Inc. . . . .	6.63%	05/01/2029		1,000	947,083	0.0
					<u>13,243,947</u>	<u>0.1</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>						
Titan Holdings II BV . . . . .	5.13%	07/15/2029	EUR	12,355	12,647,208	0.1
<b>DIENSTLEISTUNGEN</b>						
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL . . . . .	4.88%	06/01/2028	GBP	8,760	10,796,727	0.1
Monitronics International, Inc.(j) . . . . .	9.13%	04/01/2020	USD	21,822	0	0.0
					<u>10,796,727</u>	<u>0.1</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>						
Intelsat Jackson Holdings SA(c) . . . . .	8.50%	10/15/2024		2,575	1,150,521	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA(c) . . . . .	9.75%	07/15/2025		2,000	876,509	0.0
					<u>2,027,030</u>	<u>0.0</u>
<b>ENERGIE</b>						
Diamond Foreign Asset Co./Diamond Finance LLC(a) . . . . .	9.00%	04/22/2027		1,753	1,756,759	0.0
Gulfport Energy Corp. . . . .	6.38%	05/15/2025		28,214	2,822	0.0
Gulfport Energy Corp. . . . .	6.38%	01/15/2026		20,769	2,077	0.0
Vantage Drilling International(j) . . . . .	7.13%	04/01/2023		16,605	0	0.0
Vantage Drilling International(j) . . . . .	7.50%	11/01/2022		33,306	0	0.0
					<u>1,761,658</u>	<u>0.0</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>						
Exide Technologies, (First Lien)(j) . . . . .	11.00%	10/31/2024		11,269	0	0.0
Exide Technologies, (Exchange Priority)(j) . . . . .	11.00%	10/31/2024		27,457	0	0.0
					<u>0</u>	<u>0.0</u>
					<u>110,604,849</u>	<u>0.6</u>
<b>FINANZINSTITUTE</b>						
<b>BANKWESEN</b>						
SNS Bank NV, Series E(d)(j) . . . . .	11.25%	12/31/2049	EUR	7,579	0	0.0
					<u>110,604,849</u>	<u>0.6</u>
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>						
<b>NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS</b>						
Grantor Trust CGCMT, Series 2015-GC17(j) . . . . .	4.49%	09/15/2048	USD	555	12,003,735	0.0
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(j) . . . . .	0.00%	10/03/2047		469	7,442,809	0.1
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(j) . . . . .	4.00%	04/15/2050		1,006	14,395,037	0.1
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(j) . . . . .	4.00%	11/15/2047		1,109	4,586,201	0.0
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(j) . . . . .	3.40%	10/15/2057		581	8,373,640	0.0
<b>GS Mortgage Securities Trust</b>						
Series GT-E1(j) . . . . .	3.49%	10/07/2046		69	1,402,165	0.0
Series GT-E2(j) . . . . .	3.49%	10/07/2046		164	6,218,644	0.1
Series GT-F3(j) . . . . .	3.49%	10/07/2046		155	4,652,734	0.0
Series GT-F4(j) . . . . .	3.49%	10/07/2046		41	2,439,248	0.0
Series GT-G1(j) . . . . .	3.49%	10/07/2046		636	7,674,532	0.1
Series GT-G2(j) . . . . .	3.49%	10/07/2046		386	4,095,383	0.0
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-LC9, Class G . . . . .	4.36%	12/15/2047		13,837	10,241,407	0.1
					<u>83,525,535</u>	<u>0.5</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
Digicel Group Holdings Ltd.(a)	10.00%	04/01/2024	USD 40,952	\$ 40,780,666	0.2%
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	14,252	14,575,587	0.1
				<u>55,356,253</u>	<u>0.3</u>
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Tonon Luxembourg SA(a)(c)(j)	6.50%	10/31/2024	4,691	0	0.0
USJ-Acucar e Alcool S/A(c)	9.88%	11/09/2023	16,713	8,690,856	0.1
Virgolino de Oliveira Finance SA(j)(k)	10.50%	01/28/2018	27,458	2,746	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(j)(k)	10.88%	01/13/2020	8,270	827	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(j)(k)	11.75%	02/09/2022	32,498	3,250	0.0
				<u>8,697,679</u>	<u>0.1</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	45,768	183,072	0.0
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
K2016470219 South Africa Ltd.(a)(j)	3.00%	12/31/2022	16,510	0	0.0
K2016470260 South Africa Ltd.(a)(j)	25.00%	12/31/2022	10,442	0	0.0
				<u>0</u>	<u>0.0</u>
				<u>64,237,004</u>	<u>0.4</u>
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026	2,777	2,786,903	0.0
				<u>67,023,907</u>	<u>0.4</u>
<b>GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
State of California, Series 2010	7.60%	11/01/2040	5,645	9,034,119	0.1
State of Illinois, Series 2010	7.35%	07/01/2035	21,250	25,687,117	0.1
Wisconsin Public Finance Authority, Series 2021	5.75%	07/25/2041	15,000	15,749,346	0.1
				<u>50,470,582</u>	<u>0.3</u>
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>CLO – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class E(f)	7.51%	01/20/2034	2,000	1,940,022	0.0
Apidos CLO XXIII, Series 2015-23A, Class ER(f)	6.44%	04/15/2033	1,752	1,693,337	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class ER(f)	6.40%	10/20/2030	7,000	6,797,322	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd., Series 2018-29A, Class D(f)	3.35%	10/19/2031	3,000	2,952,465	0.0
Octagon Investment Partners 30 Ltd., Series 2017-1A, Class D(f)	6.45%	03/17/2030	1,000	953,405	0.0
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class E(f)	5.74%	04/15/2031	10,000	8,943,870	0.1
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class E(f)	7.25%	02/25/2034	3,000	2,886,783	0.0
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class E(f)	6.71%	07/20/2034	8,350	8,016,501	0.1
York CLO-3 Ltd., Series 2016-1A, Class ER(f)	6.65%	10/20/2029	438	417,993	0.0
				<u>34,601,698</u>	<u>0.2</u>
<b>VORZUGSAKTIE</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
Exide International Holdings LP(j)	0.00%		21,353	18,203,432	0.1
<b>ENERGIE</b>					
Gulfport Energy Corp.(j)	10.00%		2,647	13,235,000	0.1
Gulfport Energy Corp.	10.00%		114	570,000	0.0
				<u>32,008,432</u>	<u>0.2</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG</b>					
<b>INFLATIONSgebundene Wertpapiere</b>					
<b>KOLUMBIEN</b>					
Fideicomiso PA Costera(j)	6.25%	01/15/2034	COP 18,690,784	4,772,684	0.0
Fideicomiso PA Pacifico Tres	7.00%	01/15/2035	97,872,936	27,077,233	0.2
				<u>31,849,917</u>	<u>0.2</u>
<b>ABS-ANLEIHEN</b>					
<b>SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS</b>					
<b>Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust</b>					
Series 2019-43, Class PT	5.97%	11/15/2044	USD 1,221	1,202,348	0.0
Series 2019-36, Class PT	13.16%	10/17/2044	3,953	3,940,480	0.0
<b>Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I</b>					
Series 2019-24, Class PT	11.14%	08/15/2044	2,279	2,269,543	0.0
Series 2018-20, Class PT	12.93%	11/16/2043	675	668,931	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Consumer Loan Underlying Bond Club Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-4, Class PT. ....	12.21%	05/15/2043	USD 286	\$ 279,261	0.0%
Series 2018-12, Class PT. ....	14.26%	06/15/2043	439	430,079	0.0
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust,					
Series 2018-3, Class PT. ....	11.89%	03/16/2043	165	159,028	0.0
SoFi Consumer Loan Program LLC,					
Series 2016-1, Class R(j) . . . . .	0.00%	08/25/2025	1,984	1,971,249	0.0
SoFi Consumer Loan Program Trust,					
Series 2018-1, Class R1(j) . . . . .	0.00%	02/25/2027	355	5,420,588	0.1
				<u>16,341,507</u>	<u>0.1</u>
<b>OPTIONSSCHEINE</b>					
Battalion Oil Corp., expiring 10/08/2022(j) . . . . .			7,289	0	0.0
SandRidge Energy, Inc., A-CW22 . . . . .			94,880	2,846	0.0
SandRidge Energy, Inc., B-CW22 . . . . .			39,948	443	0.0
Willscot Corp.(j) . . . . .			500,414	10,091,049	0.1
				<u>10,094,338</u>	<u>0.1</u>
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Bellemeade Re Ltd., Series 2019-4A, Class B1(f) . . . . .	4.04%	10/25/2029	USD 6,083	5,937,196	0.0
Radnor Re Ltd., Series 2020-1, Class B1(f) . . . . .	3.19%	01/25/2030	1,862	1,798,117	0.0
				<u>7,735,313</u>	<u>0.0</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Lloyds Banking Group PLC(d) . . . . .	6.00%	06/07/2032	GBP 4,459	5,576,342	0.0
<b>SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
Digicel Group Holdings Ltd.(a)(d) . . . . .	7.00%	03/15/2022	USD 1,298	1,064,451	0.0
				<u>630,885,916</u>	<u>3.6</u>
<b>Gesamtanlagen</b>				<u>\$ 17,441,786,052</u>	<u>99.3%</u>
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(l) . . . . .	(0.21)%	–		137,870	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(l) . . . . .	0.01 %	–		319,679	0.0
Barclays, London(l) . . . . .	0.01 %	–		5,370,603	0.0
BBH, Grand Cayman(l) . . . . .	0.25 %	–		39,196	0.0
BBH, Grand Cayman(l) . . . . .	3.00 %	–		4,537,368	0.0
BNP Paribas, Paris(l) . . . . .	0.08 %	–		101,517	0.0
Citibank, New York(l) . . . . .	0.01 %	–		358,869,613	2.0
SEB, Stockholm(l) . . . . .	0.10 %	–		1,640,353	0.0
Sumitomo, Tokyo(l) . . . . .	(0.78)%	–		19,009,129	0.1
<b>Termineinlagen insgesamt</b> . . . . .				<u>390,025,328</u>	<u>2.1</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> . . . . .				<u>(275,287,177)</u>	<u>(1.4)</u>
<b>Nettovermögen</b> . . . . .				<u>\$ 17,556,524,203</u>	<u>100.0%</u>

**TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
<b>Long</b>					
U.S. 10 Yr Ultra Futures . . . . .	06/21/2022	700	\$ 97,923,430	\$ 98,929,688	\$ 1,006,258
U.S. Long Bond (CBT) Futures . . . . .	06/21/2022	102	15,922,938	15,982,125	59,187
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures . . . . .	06/30/2022	3,282	385,993,430	388,199,063	2,205,633
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures . . . . .	06/21/2022	5,969	754,415,500	760,674,438	6,258,938
<b>Short</b>					
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures . . . . .	06/21/2022	458	85,370,484	85,159,375	211,109
					<u>\$ 9,741,125</u>



**DEWISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA. ....	INR 3,612,019	USD 47,984	04/07/2022	\$ 352,454
Bank of America, NA. ....	USD 19,866	EUR 17,320	05/12/2022	(392,081)
Barclays Bank PLC .....	RUB 550,072	USD 7,360	03/02/2022	2,266,921
Barclays Bank PLC .....	GBP 38,644	USD 52,876	03/17/2022	1,027,900
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD 40,718	USD 29,159	03/04/2022	(412,886)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CAD 2,419	USD 1,899	03/04/2022	(9,662)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CAD 273	USD 216	03/04/2022	79
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CNH 29,893	USD 4,696	03/04/2022	(40,713)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	GBP 628	USD 840	03/04/2022	(1,743)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	GBP 4,251	USD 5,767	03/04/2022	63,299
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 6,842	USD 5,077	03/04/2022	30,187
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 664,154	AUD 929,659	03/04/2022	11,068,696
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 45,016	CAD 57,072	03/04/2022	11,842
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 47,855	CNH 303,461	03/04/2022	231,863
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 70,703	GBP 52,109	03/04/2022	(798,234)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 91	GBP 68	03/04/2022	90
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 105,059	SGD 141,564	03/04/2022	(640,006)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 533,514	ZAR 8,190,042	03/04/2022	(1,001,679)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 10,729	ZAR 166,302	03/04/2022	84,096
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR 77,658	USD 5,043	03/04/2022	(6,072)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR 388,164	USD 25,525	03/04/2022	286,837
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CAD 2,359	USD 1,851	03/14/2022	(9,628)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CNH 12,730	USD 2,007	03/14/2022	(10,438)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 39	USD 44	03/14/2022	(50)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 9,954	USD 11,288	03/14/2022	120,917
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	GBP 628	USD 840	03/14/2022	(1,857)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	GBP 2,566	USD 3,483	03/14/2022	39,960
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	PLN 473	USD 117	03/14/2022	4,516
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 4,851	USD 3,596	03/14/2022	17,826
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 44,285	CAD 56,306	03/14/2022	140,148
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 46,599	CNH 297,011	03/14/2022	432,634
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 81,408	EUR 71,477	03/14/2022	(1,224,154)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 68,315	GBP 50,501	03/14/2022	(560,231)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 91	GBP 68	03/14/2022	98
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 2,905	PLN 11,508	03/14/2022	(165,946)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 97,441	SGD 131,012	03/14/2022	(811,350)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 371,426	ZAR 5,653,176	03/14/2022	(4,346,486)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR 292,560	USD 19,233	03/14/2022	235,875
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD 28,769	USD 20,641	03/15/2022	(257,733)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 566,576	AUD 791,031	03/15/2022	8,055,041
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD 13,439	USD 9,687	03/18/2022	(76,284)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CHF 127	USD 137	03/18/2022	(1,705)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 39	USD 44	03/18/2022	(54)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 4,375	USD 4,945	03/18/2022	35,950
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	NZD 3,969	USD 2,671	03/18/2022	(13,484)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 627,851	AUD 875,706	03/18/2022	8,330,989
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 10,794	CNH 9,960	03/18/2022	74,321
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 93,052	EUR 81,863	03/18/2022	(1,199,320)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 7	NZD 10	03/18/2022	(3)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 100,456	NZD 150,925	03/18/2022	1,638,173
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 321,694	ZAR 4,874,147	03/18/2022	(5,380,477)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR 109,421	USD 7,187	03/18/2022	86,325
Citibank, NA .....	USD 14,421	EUR 12,673	05/12/2022	(172,234)
Deutsche Bank AG .....	USD 6,676	RUB 550,072	03/02/2022	(1,582,253)
Deutsche Bank AG .....	RUB 550,072	USD 6,574	03/24/2022	1,481,246
JPMorgan Chase Bank, NA .....	USD 6,689	RUB 550,072	05/06/2022	(1,908,567)
Morgan Stanley & Co., Inc. ....	MXN 169,180	USD 8,200	03/24/2022	(26,783)
Morgan Stanley & Co., Inc. ....	COP 159,104,554	USD 40,034	03/25/2022	(276,282)
Morgan Stanley & Co., Inc. ....	EUR 388,829	USD 444,297	04/11/2022	7,587,032
Morgan Stanley & Co., Inc. ....	CAD 19,000	USD 14,943	04/22/2022	(49,122)
Standard Chartered Bank .....	IDR 599,686,176	USD 41,530	04/28/2022	(5,897)
UBS AG .....	EUR 388,829	USD 444,927	05/12/2022	7,744,964
UBS AG .....	USD 21,066	EUR 18,682	05/12/2022	(60,563)
				<u>\$ 30,006,302</u>
			Wertsteigerung	\$ 51,450,279
			Wertminderung	\$ (21,443,977)

+ 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)
<b>Kaufkontrakte</b>					
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 27, 5 Year Index	06/20/2022	EUR 4	\$ (44)	\$ (8)
<b>Verkaufskontrakte</b>					
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 37, 5 Year Index	05/11/2063	USD 1,133,240	63,273,027	(36,921,151)
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Ford Motor Company	05/11/2063	6,370	313,492	558,573
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	iTraxx Europe Crossover Series 36, 5 Year Index	06/20/2026	EUR 682,700	49,659,356	(38,889,625)
Insgesamt				\$ 113,245,831	\$ (75,252,211)
				Wertsteigerung	\$ 558,573
				Wertminderung	\$ (75,810,784)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Verkaufskontrakte</b>						
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,400	\$ (1,013,280)	\$ (301,231)	\$ (712,049)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(715,099)	(1,311,461)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(71,919)	(1,954,641)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,600	(4,053,120)	(1,329,563)	(2,723,557)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,600	(4,053,120)	79,808	(4,132,928)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	17,890	(7,552,989)	(2,771,971)	(4,781,018)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	24,000	(10,132,800)	(5,158,590)	(4,974,210)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	215,272	(90,887,973)	(95,096,616)	4,208,643
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,195	(290,135)	(131,215)	(158,920)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,643	(398,936)	(221,998)	(176,938)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	06/20/2022	4,979	(1,208,896)	(627,835)	(581,061)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	11,493	(4,852,395)	(5,599,153)	746,758
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	21,672	(9,149,918)	(10,392,073)	1,242,155
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,228	(1,755,074)	(771,247)	(983,827)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,585	(870,405)	(380,156)	(490,249)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	19,480	(4,729,683)	(1,956,955)	(2,772,728)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	118,699	(28,820,069)	(11,143,307)	(17,676,762)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,987	(725,337)	(299,020)	(426,317)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,987	(725,337)	(297,063)	(428,274)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,107	(997,097)	(432,893)	(564,204)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,040	(1,466,632)	(672,406)	(794,226)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(1,173,260)	(1,244,531)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,334	(1,829,984)	(2,075,691)	245,707
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,334	(1,829,984)	(2,075,691)	245,707
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,600	(4,053,120)	(1,392,830)	(2,660,290)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	12/20/2026	91,707	(38,718,645)	(17,996,950)	(20,721,695)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	292,051	(123,304,017)	(54,527,829)	(68,776,188)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	32	(7,737)	(4,305)	(3,432)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,114	(513,297)	(216,726)	(296,571)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,420	(1,073,257)	(1,140,147)	66,890
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,420	(1,073,257)	(950,364)	(122,893)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(490,037)	(718,859)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,455	(2,052,946)	(860,565)	(1,192,381)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,841	(2,146,515)	(1,963,711)	(182,804)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,841	(2,146,515)	(1,963,711)	(182,804)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	14,937	(3,626,687)	(2,043,251)	(1,583,436)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	17,275	(4,194,384)	(1,769,983)	(2,424,401)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	24,895	(6,044,478)	(3,362,427)	(2,682,051)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	87,382	(21,216,358)	(12,878,984)	(8,337,374)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(664,781)	(1,361,779)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,600	(4,053,120)	(1,329,563)	(2,723,557)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,842	(1,175,530)	(484,301)	(691,229)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(512,350)	(698,546)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(671,915)	(536,981)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(1,019,032)	(1,398,759)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(1,358,825)	(1,058,966)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(1,452,526)	(965,265)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	14,937	(3,626,687)	(2,015,744)	(1,610,943)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	14,937	(3,626,687)	(2,183,652)	(1,443,035)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	19,916	(4,835,582)	(2,758,155)	(2,077,427)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	24,895	(6,044,478)	(3,631,315)	(2,413,163)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 49,790	\$ (12,088,955)	\$ (6,874,092)	\$ (5,214,863)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,831	(1,617,600)	(1,610,553)	(7,047)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(435,053)	(1,591,507)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,713	(2,834,347)	(2,711,999)	(122,348)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,713	(2,834,347)	(2,695,951)	(138,396)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,714	(2,834,752)	(2,744,486)	(90,266)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,714	(2,834,752)	(2,728,436)	(106,316)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,714	(2,834,752)	(2,969,935)	135,183
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,662	(3,234,795)	(2,745,440)	(489,355)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,662	(3,234,795)	(2,727,310)	(507,485)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	8,669	(3,659,966)	(4,063,018)	403,052
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,295	(314,313)	(165,317)	(148,996)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(1,348,051)	(1,069,740)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	11,503	(2,793,032)	(1,136,375)	(1,656,657)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	18,930	(4,596,220)	(1,888,330)	(2,707,890)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,279	(4,923,830)	(2,106,599)	(2,817,231)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	22,102	(5,366,287)	(5,805,935)	439,648
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	22,102	(5,366,287)	(5,384,024)	17,737
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	24,895	(6,044,478)	(3,267,982)	(2,776,496)
Insgesamt				<u>\$ (502,111,852)</u>	<u>\$ (316,668,009)</u>	<u>\$ (185,443,843)</u>
					Wertsteigerung	\$ 7,751,480
					Wertminderung	\$ (193,195,323)
Swaps insgesamt						<u>\$ (260,696,054)</u>

- (a) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (b) Wandelbares Wertpapier.
- (c) Not leidend.
- (d) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (e) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 28. Februar 2022.
- (f) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2022.
- (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) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (l) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
- CAD – Canadian Dollar
- CHF – Swiss Franc
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- COP – Colombian Peso
- EGP – Egyptian Pound
- EUR – Euro
- GBP – Great British Pound
- IDR – Indonesian Rupiah
- INR – Indian Rupee
- MXN – Mexican Peso
- NZD – New Zealand Dollar
- PLN – Polish Zloty
- RUB – Russian Ruble
- SGD – Singapore Dollar
- USD – United States Dollar
- ZAR – South African Rand

Glossar:

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

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>					
<b>REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
U.S. Treasury Bonds	1.13%	08/15/2040	USD 290,549	\$ 240,111,495	1.2%
U.S. Treasury Bonds	6.13%	11/15/2027	433,168	534,895,313	2.7
U.S. Treasury Bonds(a)	6.13%	08/15/2029	587,115	763,982,743	3.9
U.S. Treasury Bonds	6.25%	05/15/2030	766,144	1,024,598,196	5.2
U.S. Treasury Bonds	6.75%	08/15/2026	576,560	699,799,700	3.6
U.S. Treasury Bonds	6.88%	08/15/2025	100,000	117,437,500	0.6
U.S. Treasury Bonds	7.63%	02/15/2025	302,420	354,918,354	1.8
U.S. Treasury Notes(a)	0.50%	10/31/2027	12,892	12,006,048	0.1
U.S. Treasury Notes(a)	0.88%	06/30/2026	637,858	615,034,675	3.1
U.S. Treasury Notes	1.25%	12/31/2026	430,730	421,105,660	2.1
U.S. Treasury Notes(a)	2.25%	11/15/2024	91,791	93,397,139	0.5
				<u>4,877,286,823</u>	<u>24.8</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
ASP Unifrax Holdings, Inc.	5.25%	09/30/2028	5,598	5,387,886	0.0
Axalta Coating Systems LLC	3.38%	02/15/2029	3,674	3,372,043	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026	1,879	1,979,697	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	9.88%	10/17/2025	21,096	23,492,419	0.1
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	9,573	9,567,834	0.1
Glatfelter Corp.	4.75%	11/15/2029	8,295	7,905,310	0.1
Graphic Packaging International LLC	4.75%	07/15/2027	4,299	4,414,125	0.0
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	27,796	27,056,856	0.1
Joseph T Ryerson & Son, Inc.	8.50%	08/01/2028	7,764	8,399,922	0.1
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	26,838	27,978,199	0.2
PIC AU Holdings LLC/PIC AU Holdings Corp.	10.00%	12/31/2024	6,034	6,215,020	0.0
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	5.38%	11/01/2026	22,466	22,441,581	0.1
WR Grace Holdings LLC	4.88%	06/15/2027	6,793	6,765,098	0.0
				<u>154,975,990</u>	<u>0.8</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	04/30/2025	5,709	5,769,658	0.0
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	4,501	4,600,604	0.0
Colfax Corp.	6.38%	02/15/2026	2,729	2,812,442	0.0
Eco Material Technologies, Inc.	7.88%	01/31/2027	19,423	19,650,803	0.1
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	34,252	34,092,867	0.2
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	7,955	7,808,784	0.0
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	4,000	3,931,841	0.0
Ritchie Bros Auctioneers, Inc.	5.38%	01/15/2025	575	584,490	0.0
Stevens Holding Co., Inc.	6.13%	10/01/2026	4,933	5,108,673	0.0
TK Elevator US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	21,995	21,926,668	0.1
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024	13,414	13,336,420	0.1
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024	8,943	9,544,294	0.1
Wesco Distribution, Inc.	7.13%	06/15/2025	12,456	13,036,796	0.1
Wesco Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	9,211	9,891,300	0.1
				<u>152,095,640</u>	<u>0.8</u>
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	37,082	37,363,175	0.2
Altice Financing SA	5.00%	01/15/2028	27,955	25,275,981	0.1
Altice Financing SA	5.75%	08/15/2029	24,913	22,682,785	0.1
Banjay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025	8,926	8,865,696	0.1
Belo Corp.	7.75%	06/01/2027	2,604	2,970,143	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	10,354	9,976,836	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	06/01/2033	61,959	58,062,284	0.3
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.75%	02/01/2032	10,382	10,092,857	0.1
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	8,724	8,712,943	0.0
CSC Holdings LLC	5.00%	11/15/2031	27,026	22,520,301	0.1
CSC Holdings LLC	5.75%	01/15/2030	18,428	16,304,397	0.1
DISH DBS Corp.	5.25%	12/01/2026	25,055	24,439,295	0.1
DISH DBS Corp.	5.75%	12/01/2028	28,439	27,230,531	0.1
DISH DBS Corp.	7.75%	07/01/2026	5,157	5,204,051	0.0
Gray Escrow II, Inc.	5.38%	11/15/2031	42,997	41,388,919	0.2
iHeartCommunications, Inc.	5.25%	08/15/2027	836	833,077	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	22,917	23,521,257	0.1
Liberty Interactive LLC	8.25%	02/01/2030	2,000	1,965,005	0.0
McGraw-Hill Education, Inc.	5.75%	08/01/2028	37,341	35,411,404	0.2
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026	8,693	6,258,620	0.0
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028	14,789	13,094,604	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	22,785	20,125,407	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	3.88%	09/01/2031	10,359	9,555,993	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Sirius XM Radio, Inc. ....	5.50%	07/01/2029	USD 20,137	\$ 20,591,183	0.1%
Summer BC Bidco B LLC .....	5.50%	10/31/2026	700	675,263	0.0
Univision Communications, Inc. ....	4.50%	05/01/2029	8,302	7,895,770	0.0
Univision Communications, Inc. ....	6.63%	06/01/2027	27,939	29,147,385	0.2
Univision Communications, Inc. ....	9.50%	05/01/2025	5,276	5,559,079	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC .....	4.50%	08/15/2030	946	892,834	0.0
Ziggo Bond Co. BV .....	5.13%	02/28/2030	794	739,965	0.0
Ziggo BV .....	4.88%	01/15/2030	16,189	15,415,483	0.1
				<u>512,772,523</u>	<u>2.6</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
Connect Finco SARM/Connect US Finco LLC .....	6.75%	10/01/2026	40,042	40,542,525	0.2
Consolidated Communications, Inc. ....	5.00%	10/01/2028	5,895	5,606,969	0.0
Consolidated Communications, Inc. ....	6.50%	10/01/2028	32,651	32,581,148	0.2
Embarq Corp. ....	8.00%	06/01/2036	21,303	21,177,751	0.1
Iliad Holding SASU .....	6.50%	10/15/2026	14,216	14,206,557	0.1
Iliad Holding SASU .....	7.00%	10/15/2028	9,698	9,648,788	0.0
Lumen Technologies, Inc., Series Y .....	7.50%	04/01/2024	17,638	18,523,998	0.1
Telecom Italia Capital SA .....	7.20%	07/18/2036	9,850	9,994,478	0.1
Telecom Italia Capital SA .....	7.72%	06/04/2038	7,678	7,925,273	0.0
Vmed O2 UK Financing I PLC .....	4.75%	07/15/2031	6,675	6,323,296	0.0
				<u>166,530,783</u>	<u>0.8</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
American Axle & Manufacturing, Inc. ....	6.50%	04/01/2027	4,888	4,997,879	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc. ....	6.88%	07/01/2028	10,159	10,463,770	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co. ....	6.25%	05/15/2026	20,680	21,383,947	0.1
Dana, Inc. ....	5.38%	11/15/2027	12,089	12,330,780	0.1
Goodyear Tire & Rubber Co. (The) .....	5.00%	07/15/2029	2,698	2,659,542	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The) .....	5.25%	07/15/2031	2,860	2,783,133	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(b) .....	6.00%	05/15/2027	23,494	24,029,765	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(b) .....	6.38%	05/15/2029	12,577	13,085,102	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC .....	5.50%	07/15/2029	22,261	21,134,082	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC .....	5.88%	01/15/2028	31,879	31,308,987	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC .....	7.75%	10/15/2025	34,461	36,309,394	0.2
Meritor, Inc. ....	6.25%	06/01/2025	10,388	10,798,820	0.1
Tenneco, Inc. ....	7.88%	01/15/2029	8,241	8,705,693	0.0
ZF North America Capital, Inc. ....	4.75%	04/29/2025	14,495	14,772,158	0.1
				<u>214,763,052</u>	<u>1.1</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG</b>					
Carnival Corp. ....	4.00%	08/01/2028	13,272	12,658,170	0.1
Carnival Corp. ....	5.75%	03/01/2027	58,296	56,637,479	0.3
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op. ....	5.50%	05/01/2025	52,796	54,261,938	0.3
Mattel, Inc. ....	5.88%	12/15/2027	131	138,813	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd. ....	5.38%	07/15/2027	18,007	17,646,860	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd. ....	5.50%	04/01/2028	15,887	15,529,542	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd. ....	10.88%	06/01/2023	31,966	34,228,873	0.1
Six Flags Theme Parks, Inc. ....	7.00%	07/01/2025	10,297	10,760,620	0.1
Vail Resorts, Inc. ....	6.25%	05/15/2025	8,044	8,347,936	0.0
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd. ....	5.63%	02/15/2029	8,267	7,801,421	0.0
VOC Escrow Ltd. ....	5.00%	02/15/2028	21,681	20,737,868	0.1
				<u>238,749,520</u>	<u>1.2</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Adams Homes, Inc. ....	7.50%	02/15/2025	14,225	14,459,073	0.1
Beazer Homes USA, Inc. ....	6.75%	03/15/2025	500	506,815	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC .....	4.88%	02/15/2030	28,915	26,470,111	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC .....	6.25%	09/15/2027	49,014	49,333,131	0.3
Caesars Entertainment, Inc. ....	6.25%	07/01/2025	29,496	30,584,040	0.2
Empire Communities Corp. ....	7.00%	12/15/2025	8,518	8,445,944	0.0
Forterra Finance LLC/FRTA Finance Corp. ....	6.50%	07/15/2025	8,322	8,640,377	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc. ....	5.38%	05/01/2025	2,135	2,200,612	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc. ....	5.75%	05/01/2028	1,163	1,215,394	0.0
Installed Building Products, Inc. ....	5.75%	02/01/2028	5,196	5,187,168	0.0
International Game Technology PLC .....	5.25%	01/15/2029	3,337	3,374,317	0.0
International Game Technology PLC .....	6.25%	01/15/2027	35,757	38,193,064	0.2
KB Home .....	4.80%	11/15/2029	2,965	2,965,788	0.0
KB Home .....	6.88%	06/15/2027	4,102	4,507,758	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc. ....	6.13%	09/15/2025	3,034	3,136,556	0.0
Mattamy Group Corp. ....	4.63%	03/01/2030	7,000	6,579,279	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp. ....	4.75%	02/15/2028	19,163	18,443,211	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc. ....	5.75%	01/15/2028	8,959	9,301,350	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc. ....	5.88%	06/15/2027	15,629	16,403,385	0.1
Travel + Leisure Co. ....	4.50%	12/01/2029	27,347	26,246,352	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Travel + Leisure Co. ....	4.63%	03/01/2030	USD 3,108	\$ 2,958,912	0.0%
Travel + Leisure Co. ....	6.63%	07/31/2026	13,210	14,139,544	0.1
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp. ....	5.50%	03/01/2025	11,291	11,374,463	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp. ....	5.13%	10/01/2029	13,465	13,064,456	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp. ....	7.75%	04/15/2025	14,262	14,904,030	0.1
				<u>332,635,130</u>	<u>1.7</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS</b>					
Bath & Body Works, Inc. ....	6.95%	03/01/2033	329	347,644	0.0
Bath & Body Works, Inc. ....	7.60%	07/15/2037	716	781,616	0.0
				<u>1,129,260</u>	<u>0.0</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
Arko Corp. ....	5.13%	11/15/2029	11,996	11,080,630	0.1
Asbury Automotive Group, Inc. ....	5.00%	02/15/2032	10,155	9,907,340	0.1
Bath & Body Works, Inc. ....	5.25%	02/01/2028	5,737	5,974,842	0.0
Bath & Body Works, Inc. ....	6.63%	10/01/2030	6,017	6,497,477	0.0
Bath & Body Works, Inc. ....	6.75%	07/01/2036	25,820	28,139,257	0.1
Bath & Body Works, Inc. ....	6.88%	11/01/2035	21,725	24,018,569	0.1
Bath & Body Works, Inc. ....	7.50%	06/15/2029	7,154	7,838,915	0.0
FirstCash, Inc. ....	4.63%	09/01/2028	767	723,792	0.0
FirstCash, Inc. ....	5.63%	01/01/2030	15,983	15,798,506	0.1
Michaels Cos, Inc. (The) ....	5.25%	05/01/2028	23,129	21,781,072	0.1
Murphy Oil USA, Inc. ....	4.75%	09/15/2029	11,452	11,452,053	0.1
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp. ....	4.75%	02/15/2028	33,180	33,085,565	0.2
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp. ....	6.38%	09/30/2026	10,386	10,460,968	0.1
Staples, Inc. ....	7.50%	04/15/2026	24,937	24,631,325	0.1
William Carter Co. (The) ....	5.50%	05/15/2025	8,330	8,585,399	0.0
				<u>219,975,710</u>	<u>1.1</u>
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
AdaptHealth LLC. ....	6.13%	08/01/2028	6,613	6,593,081	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC. ....	4.88%	02/15/2030	15,673	15,708,251	0.1
Bausch Health Americas, Inc. ....	8.50%	01/31/2027	4,505	4,561,851	0.0
Bausch Health Cos., Inc. ....	6.25%	02/15/2029	17,487	14,901,565	0.1
Bausch Health Cos., Inc. ....	9.00%	12/15/2025	271	281,801	0.0
CD&R Smokey Buyer, Inc. ....	6.75%	07/15/2025	1,977	2,041,837	0.0
Emergent BioSolutions, Inc. ....	3.88%	08/15/2028	1,537	1,371,269	0.0
Endo Luxembourg Finance Co. I SARL/Endo US, Inc. ....	6.13%	04/01/2029	11,048	10,408,037	0.1
Grifols Escrow Issuer SA. ....	4.75%	10/15/2028	7,443	7,011,227	0.0
Jazz Securities DAC. ....	4.38%	01/15/2029	18,355	18,130,052	0.1
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc. ....	5.00%	12/31/2026	33,210	29,949,933	0.2
Legacy LifePoint Health LLC. ....	6.75%	04/15/2025	64,710	67,019,074	0.4
ModivCare Escrow Issuer, Inc. ....	5.00%	10/01/2029	2,163	2,037,125	0.0
Par Pharmaceutical, Inc. ....	7.50%	04/01/2027	16,641	16,664,077	0.1
Post Holdings, Inc. ....	4.50%	09/15/2031	8,368	7,748,837	0.0
Post Holdings, Inc. ....	5.50%	12/15/2029	6,547	6,600,733	0.0
Post Holdings, Inc. ....	5.63%	01/15/2028	7,135	7,185,708	0.0
RP Escrow Issuer LLC. ....	5.25%	12/15/2025	24,848	24,467,154	0.1
US Acute Care Solutions LLC. ....	6.38%	03/01/2026	9,491	9,332,063	0.1
WASH Multifamily Acquisition, Inc. ....	5.75%	04/15/2026	5,706	5,741,292	0.0
				<u>257,754,967</u>	<u>1.3</u>
<b>ENERGIE</b>					
Berry Petroleum Co. LLC. ....	7.00%	02/15/2026	6,480	6,399,381	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp. ....	7.63%	12/15/2025	12,558	13,187,436	0.1
Cheniere Energy Partners LP. ....	4.50%	10/01/2029	4,266	4,347,309	0.0
CITGO Petroleum Corp. ....	6.38%	06/15/2026	13,237	13,134,251	0.1
CITGO Petroleum Corp. ....	7.00%	06/15/2025	45,862	45,979,547	0.2
Civitas Resources, Inc. ....	5.00%	10/15/2026	8,910	8,784,630	0.0
CNX Resources Corp. ....	6.00%	01/15/2029	18,821	19,233,663	0.1
Comstock Resources, Inc. ....	5.88%	01/15/2030	6,457	6,251,635	0.0
CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC. ....	5.50%	06/15/2031	18,660	18,567,721	0.1
Crescent Energy Finance LLC. ....	7.25%	05/01/2026	27,560	27,496,268	0.1
Encino Acquisition Partners Holdings LLC. ....	8.50%	05/01/2028	16,698	16,898,503	0.1
EnLink Midstream LLC. ....	5.63%	01/15/2028	31,228	31,751,665	0.2
EnLink Midstream Partners LP. ....	4.40%	04/01/2024	804	819,267	0.0
EnLink Midstream Partners LP. ....	5.05%	04/01/2045	14,978	12,392,072	0.1
EnLink Midstream Partners LP. ....	5.45%	06/01/2047	10,303	8,753,159	0.0
EnLink Midstream Partners LP. ....	5.60%	04/01/2044	1,916	1,652,914	0.0
EQM Midstream Partners LP. ....	4.50%	01/15/2029	16,753	15,642,638	0.1
EQM Midstream Partners LP. ....	4.75%	01/15/2031	15,247	14,332,468	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp. ....	6.25%	05/15/2026	5,083	4,917,748	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp. ....	6.50%	10/01/2025	3,830	3,780,951	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp. ....	7.75%	02/01/2028	40,175	39,642,587	0.2
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp. ....	8.00%	01/15/2027	32,532	32,890,467	0.2
Global Partners LP/GLP Finance Corp. ....	6.88%	01/15/2029	11,607	11,775,966	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Global Partners LP/GLP Finance Corp.....	7.00%	08/01/2027	USD 9,655	\$ 9,802,282	0.1%
Harbour Energy PLC .....	5.50%	10/15/2026	9,858	9,653,207	0.1
Hess Midstream Operations LP .....	4.25%	02/15/2030	991	957,342	0.0
Hess Midstream Operations LP .....	5.63%	02/15/2026	8,201	8,390,261	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.....	5.75%	02/01/2029	10,533	10,575,030	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.....	6.00%	02/01/2031	10,533	10,696,302	0.1
Ithaca Energy North Sea PLC .....	9.00%	07/15/2026	9,052	9,091,166	0.0
ITT Holdings LLC .....	6.50%	08/01/2029	42,132	39,491,858	0.2
Nabors Industries Ltd. ....	7.25%	01/15/2026	10,104	9,841,441	0.1
Nabors Industries Ltd. ....	7.50%	01/15/2028	12,402	11,871,781	0.1
Nabors Industries, Inc. ....	7.38%	05/15/2027	23,408	24,248,093	0.1
Neptune Energy Bondco PLC .....	6.63%	05/15/2025	3,286	3,296,442	0.0
New Fortress Energy, Inc. ....	6.75%	09/15/2025	37,249	35,788,596	0.2
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp. ....	7.50%	02/01/2026	71,875	72,166,143	0.4
Occidental Petroleum Corp.....	3.40%	04/15/2026	1,253	1,254,967	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	5.88%	09/01/2025	5,779	6,207,517	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	6.13%	01/01/2031	9,758	11,090,031	0.1
Occidental Petroleum Corp.....	8.00%	07/15/2025	10,610	11,995,683	0.1
Occidental Petroleum Corp.....	8.50%	07/15/2027	5,994	7,227,236	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	8.88%	07/15/2030	6,994	9,014,905	0.0
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.....	9.25%	05/15/2025	26,889	27,357,453	0.1
PDC Energy, Inc. ....	5.75%	05/15/2026	11,395	11,587,484	0.1
PDC Energy, Inc. ....	6.13%	09/15/2024	3,417	3,453,431	0.0
Renewable Energy Group, Inc. ....	5.88%	06/01/2028	6,942	7,497,506	0.0
SM Energy Co.....	10.00%	01/15/2025	23,179	25,350,459	0.1
Southwestern Energy Co.....	5.38%	02/01/2029	3,267	3,359,956	0.0
Summit Midstream Holdings LLC/ Summit Midstream Finance Corp. ....	8.50%	10/15/2026	14,264	14,127,055	0.1
Transocean Phoenix 2 Ltd.. ..	7.75%	10/15/2024	4,649	4,712,757	0.0
Transocean Poseidon Ltd. ....	6.88%	02/01/2027	7,649	7,457,394	0.0
Transocean Sentry Ltd. ....	5.38%	05/15/2023	20,958	20,449,907	0.1
				<u>786,645,931</u>	<u>4.0</u>
<b>SONSTIGE INDUSTRIEWERTE</b>					
Avient Corp.....	5.75%	05/15/2025	3,318	3,400,395	0.0
Interface, Inc.....	5.50%	12/01/2028	5,810	5,852,566	0.1
				<u>9,252,961</u>	<u>0.1</u>
<b>DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp. ....	6.63%	07/15/2026	41,102	42,119,166	0.2
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL .....	4.63%	06/01/2028	21,890	20,658,161	0.1
APX Group, Inc. ....	6.75%	02/15/2027	14,450	14,841,244	0.1
Aramark Services, Inc.....	6.38%	05/01/2025	15,856	16,416,713	0.1
Cars.com, Inc. ....	6.38%	11/01/2028	13,634	13,762,118	0.1
ION Trading Technologies SARL .....	5.75%	05/15/2028	11,107	10,957,406	0.1
Millennium Escrow Corp. ....	6.63%	08/01/2026	24,610	23,994,993	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC .....	5.50%	09/01/2028	26,526	25,654,146	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC .....	5.75%	11/01/2028	34,084	30,753,350	0.1
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.....	5.63%	10/01/2028	10,002	9,677,012	0.0
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.....	5.88%	10/01/2030	3,599	3,486,824	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc. ....	5.25%	04/15/2024	9,896	10,114,523	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc. ....	5.75%	04/15/2026	12,000	12,330,846	0.1
Sabre GLBL, Inc.....	7.38%	09/01/2025	2,660	2,757,495	0.0
Sabre GLBL, Inc.....	9.25%	04/15/2025	17,308	19,525,880	0.1
TripAdvisor, Inc. ....	7.00%	07/15/2025	9,576	9,963,685	0.1
ZipRecruiter, Inc.....	5.00%	01/15/2030	19,625	19,338,911	0.1
				<u>286,352,473</u>	<u>1.5</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Avaya, Inc.....	6.13%	09/15/2028	40,340	38,983,939	0.2
Boxer Parent Co., Inc. ....	7.13%	10/02/2025	9,123	9,444,646	0.1
CommScope, Inc.....	6.00%	03/01/2026	210	215,046	0.0
Dell International LLC/EMC Corp.....	5.85%	07/15/2025	6,238	6,856,061	0.0
LogMeIn, Inc. ....	5.50%	09/01/2027	3,670	3,493,748	0.0
NCR Corp.....	5.75%	09/01/2027	10,151	10,308,795	0.1
NCR Corp.....	6.13%	09/01/2029	7,437	7,719,732	0.0
Seagate HDD Cayman .....	4.09%	06/01/2029	5,300	5,102,471	0.0
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.....	7.50%	09/01/2025	76,800	75,975,577	0.4
				<u>158,100,015</u>	<u>0.8</u>
<b>TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN</b>					
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd.....	5.50%	04/20/2026	8,593	8,806,078	0.0
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd.....	5.75%	04/20/2029	13,211	13,501,376	0.1
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ HawaiianMiles Loyalty Ltd. ....	5.75%	01/20/2026	10,686	10,850,270	0.1
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.....	8.00%	09/20/2025	30,569	33,243,486	0.1
				<u>66,401,210</u>	<u>0.3</u>



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc. ....	6.13%	10/15/2026	USD 19,507	\$ 18,967,352	0.1%
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc. ....	5.38%	03/01/2029	3,641	3,579,679	0.0
PROG Holdings, Inc. ....	6.00%	11/15/2029	20,692	19,864,894	0.1
				<u>42,411,925</u>	<u>0.2</u>
				<u>3,600,547,090</u>	<u>18.3</u>
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Alliance Data Systems Corp. ....	4.75%	12/15/2024	33,539	33,451,755	0.2
Alliance Data Systems Corp. ....	7.00%	01/15/2026	15,902	16,319,428	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(c) ....	6.50%	03/05/2025	48,200	48,342,774	0.3
Banco Santander SA(c) ....	7.50%	02/08/2024	20,400	21,223,861	0.1
Credit Suisse Group AG(c) ....	6.25%	12/18/2024	45,694	46,831,714	0.3
Credit Suisse Group AG(c) ....	7.50%	07/17/2023	32,959	33,712,061	0.1
Credit Suisse Group AG(c) ....	7.50%	12/11/2023	27,004	28,297,884	0.1
Intesa Sanpaolo SpA ....	5.02%	06/26/2024	29,505	30,324,378	0.2
Intesa Sanpaolo SpA ....	5.71%	01/15/2026	3,000	3,172,161	0.0
Societe Generale SA(c) ....	7.88%	12/18/2023	9,332	9,769,605	0.0
Societe Generale SA(c) ....	8.00%	09/29/2025	16,232	17,664,440	0.1
				<u>289,110,061</u>	<u>1.5</u>
<b>MAKLER</b>					
Jane Street Group/JSJ Finance, Inc. ....	4.50%	11/15/2029	17,383	16,939,259	0.1
NFP Corp. ....	4.88%	08/15/2028	8,605	8,330,145	0.0
				<u>25,269,404</u>	<u>0.1</u>
<b>FINANZEN</b>					
Aircastle Ltd.(c) ....	5.25%	06/15/2026	15,194	14,603,824	0.1
Castlelake Aviation Finance DAC ....	5.00%	04/15/2027	10,524	9,999,279	0.0
goeasy Ltd. ....	5.38%	12/01/2024	21,183	21,394,830	0.1
Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp. ....	5.00%	08/15/2028	15,619	15,071,127	0.1
				<u>61,069,060</u>	<u>0.3</u>
<b>REITS</b>					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL ....	4.50%	04/01/2027	29,109	27,145,757	0.1
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC /BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL ....	5.75%	05/15/2026	9,735	9,634,491	0.0
Diversified Healthcare Trust ....	9.75%	06/15/2025	27,934	29,539,680	0.1
Iron Mountain, Inc. ....	4.88%	09/15/2029	10,460	10,093,900	0.1
Iron Mountain, Inc. ....	5.00%	07/15/2028	10,020	9,935,042	0.1
Iron Mountain, Inc. ....	5.25%	03/15/2028	11,339	11,353,616	0.1
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc. ....	5.63%	05/01/2024	1,235	1,284,402	0.0
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc. ....	5.75%	02/01/2027	19,477	21,110,837	0.1
Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/ PK Finance Co-Issuer ....	4.88%	05/15/2029	13,793	13,302,200	0.1
				<u>133,399,925</u>	<u>0.7</u>
				<u>508,848,450</u>	<u>2.6</u>
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
Calpine Corp. ....	5.13%	03/15/2028	23,905	23,052,668	0.1
Talen Energy Supply LLC ....	6.50%	06/01/2025	2,406	1,010,182	0.0
Talen Energy Supply LLC ....	7.25%	05/15/2027	62,448	55,897,179	0.3
Terraform Global Operating LLC ....	6.13%	03/01/2026	7,871	7,899,069	0.0
Vistra Corp.(c) ....	7.00%	12/15/2026	16,102	15,983,855	0.1
Vistra Corp.(c) ....	8.00%	10/15/2026	19,514	20,080,824	0.1
Vistra Operations Co. LLC ....	5.63%	02/15/2027	20,523	21,005,894	0.1
				<u>144,929,671</u>	<u>0.7</u>
				<u>4,254,325,211</u>	<u>21.6</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
ABN AMRO Bank NV ....	4.80%	04/18/2026	7,000	7,463,110	0.0
AIB Group PLC ....	4.26%	04/10/2025	60,316	61,978,105	0.3
Ally Financial, Inc. ....	5.80%	05/01/2025	8,159	8,832,711	0.0
Ally Financial, Inc. ....	8.00%	11/01/2031	11,107	14,556,656	0.1
AmSouth Bancorp. ....	6.75%	11/01/2025	11,929	13,530,716	0.1
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. ....	4.40%	05/19/2026	8,780	9,296,270	0.0
Australia & New Zealand Banking Group Ltd./ United Kingdom(c) ....	6.75%	06/15/2026	43,923	47,802,868	0.2
Banco Santander SA ....	5.18%	11/19/2025	74,800	79,885,383	0.4

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Bank of America Corp., Series B	8.05%	06/15/2027	USD 34,006	\$ 40,860,811	0.2%
Bank of America Corp., Series X(c)	6.25%	09/05/2024	15,203	15,850,167	0.1
Bank of America Corp., Series Z(c)	6.50%	10/23/2024	14,620	15,593,813	0.1
Bank of Ireland Group PLC	4.50%	11/25/2023	17,000	17,623,783	0.1
Barclays Bank PLC	7.63%	11/21/2022	8,608	8,934,197	0.0
BBVA USA	5.90%	04/01/2026	7,500	8,395,472	0.0
BNP Paribas SA	4.63%	03/13/2027	13,920	14,674,304	0.1
BNP Paribas SA(c)	6.75%	03/14/2022	25,631	25,672,894	0.1
BPCE SA	4.63%	07/11/2024	17,050	17,733,811	0.1
BPCE SA	5.15%	07/21/2024	23,413	24,587,276	0.1
Capital One Financial Corp.	3.75%	03/09/2027	16,128	16,853,873	0.1
Citigroup, Inc.(c)	3.88%	02/18/2026	24,915	23,695,543	0.1
Citigroup, Inc.(c)	5.95%	01/30/2023	14,902	15,189,703	0.1
Citigroup, Inc., Series P(c)	5.95%	05/15/2025	10,465	10,852,126	0.1
Citigroup, Inc., Series U(c)	5.00%	09/12/2024	26,500	26,658,133	0.1
Citigroup, Inc., Series V(c)	4.70%	01/30/2025	9,977	9,779,893	0.1
Citigroup, Inc., Series W(c)	4.00%	12/10/2025	16,145	15,523,960	0.1
Commerzbank AG	8.13%	09/19/2023	12,284	13,214,772	0.1
Credit Agricole SA	4.38%	03/17/2025	4,798	4,976,706	0.0
Credit Agricole SA(c)	8.13%	12/23/2025	21,494	24,234,485	0.1
Credit Agricole SA	8.13%	03/23/2170	19,693	22,204,819	0.1
Discover Bank	3.45%	07/27/2026	10,000	10,286,273	0.1
Discover Bank	4.68%	08/09/2028	42,248	43,360,833	0.2
DNB Bank ASA(c)	6.50%	03/26/2022	63,959	64,147,022	0.3
Dresdner Funding Trust I	8.15%	06/30/2031	11,620	15,390,862	0.1
First-Citizens Bank & Trust Co.	2.97%	09/27/2025	2,736	2,761,834	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series O(c)	5.30%	11/10/2026	1,910	1,987,516	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(c)	5.00%	11/10/2022	15,687	15,062,414	0.1
HSBC Holdings PLC(c)	6.38%	03/30/2025	10,483	10,876,112	0.1
HSBC Holdings PLC(c)	6.50%	03/23/2028	17,335	18,020,204	0.1
ING Groep NV(c)	6.75%	04/16/2024	31,733	33,115,327	0.2
ING Groep NV(c)	6.88%	04/16/2022	3,000	3,008,844	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series S(c)	6.75%	02/01/2024	13,340	14,053,846	0.1
Lloyds Banking Group PLC	4.58%	12/10/2025	22,665	23,743,085	0.1
Lloyds Banking Group PLC(c)	7.50%	06/27/2024	25,585	27,167,206	0.1
Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.	4.60%	03/27/2024	22,608	23,551,718	0.1
Natwest Group PLC, Series U(c)(d)	2.54%	03/31/2022	15,700	15,699,850	0.1
Nordea Bank Abp(c)	6.63%	03/26/2026	59,046	62,692,807	0.3
Santander Holdings USA, Inc.	4.40%	07/13/2027	51,158	53,766,923	0.3
Societe Generale SA	4.25%	04/14/2025	11,148	11,415,017	0.1
Societe Generale SA	4.25%	08/19/2026	17,260	17,638,389	0.1
Societe Generale SA	4.75%	11/24/2025	22,112	23,030,196	0.1
Standard Chartered PLC(c)(d)	1.81%	01/30/2027	34,013	29,864,820	0.2
Standard Chartered PLC	4.30%	02/19/2027	1,500	1,542,322	0.0
Standard Chartered PLC	5.20%	01/26/2024	4,628	4,824,716	0.0
Standard Chartered PLC(c)	7.75%	04/02/2023	3,200	3,324,885	0.0
Svenska Handelsbanken AB(c)	4.75%	03/01/2031	13,600	13,331,134	0.1
Swedbank AB(c)	6.00%	03/17/2022	5,200	5,201,763	0.0
Swedbank AB, Series NC5(c)	5.63%	09/17/2024	13,600	13,776,173	0.1
UBS AG	5.13%	05/15/2024	7,742	8,055,756	0.0
UBS AG/Stamford CT	7.63%	08/17/2022	14,464	14,821,989	0.1
UBS Group AG(c)	7.00%	01/31/2024	12,992	13,511,680	0.1
UBS Group AG(c)	7.00%	02/19/2025	28,847	30,685,996	0.2
UniCredit SpA	4.63%	04/12/2027	1,425	1,494,770	0.0
UniCredit SpA	7.83%	12/04/2023	24,650	26,708,471	0.1
Wells Fargo & Co., Series U(c)	5.88%	06/15/2025	13,500	14,207,143	0.1
				<u>1,288,584,256</u>	<u>6.6</u>
MAKLER					
Charles Schwab Corp. (The), Series G(c)	5.38%	06/01/2025	41,119	43,412,808	0.2
FINANZEN					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	2.88%	08/14/2024	3,072	3,081,462	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.00%	10/29/2028	35,999	34,658,081	0.2
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.30%	01/23/2023	162	164,145	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.88%	01/23/2028	7,258	7,372,009	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	10/01/2025	12,253	12,751,266	0.1
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	6.50%	07/15/2025	3,140	3,460,447	0.0
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	8,142	7,774,237	0.0
Aircastle Ltd.	4.13%	05/01/2024	4,820	4,932,410	0.0
Aircastle Ltd.	4.25%	06/15/2026	1,132	1,165,205	0.0
Aircastle Ltd.	4.40%	09/25/2023	12,230	12,537,017	0.1
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	46,031	48,798,571	0.3
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	5,354	5,097,884	0.0
Aviation Capital Group LLC	1.95%	09/20/2026	13,175	12,394,345	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	8,286	8,189,855	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Synchrony Financial	2.88%	10/28/2031	USD 9,897	\$ 9,195,982	0.1%
Synchrony Financial	3.95%	12/01/2027	13,111	13,524,629	0.1
Synchrony Financial	4.50%	07/23/2025	4,912	5,151,425	0.0
Synchrony Financial	5.15%	03/19/2029	1,500	1,640,614	0.0
				<u>191,889,584</u>	<u>1.0</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
ACE Capital Trust II	9.70%	04/01/2030	31,826	44,408,223	0.2
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	8,665	10,829,418	0.1
Allstate Corp. (The), Series B	5.75%	08/15/2053	35,856	36,066,745	0.2
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.63%	08/15/2052	21,351	22,465,329	0.1
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.75%	08/15/2050	18,619	19,367,405	0.1
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co., Ltd.	5.63%	06/24/2046	3,300	3,496,165	0.0
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(d)	2.63%	02/12/2047	61,341	54,593,490	0.3
Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037	7,135	9,476,973	0.0
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	11,997	15,206,081	0.1
MetLife, Inc.	6.40%	12/15/2036	7,456	8,425,280	0.0
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039	8,590	13,362,088	0.1
Nationwide Mutual Insurance Co.(d)	2.49%	12/15/2024	1,000	999,780	0.0
Prudential Financial, Inc.	5.20%	03/15/2044	42,601	43,007,232	0.2
Prudential Financial, Inc.	5.63%	06/15/2043	52,407	53,943,979	0.3
Swiss Re Finance Luxembourg SA	5.00%	04/02/2049	15,690	16,653,634	0.1
Voya Financial, Inc.	5.65%	05/15/2053	68,904	69,555,185	0.3
				<u>421,857,007</u>	<u>2.1</u>
<b>SONSTIGE FINANZWERTE</b>					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	04/03/2026	6,125	6,397,189	0.0
<b>REITS</b>					
Brixmor Operating Partnership LP	4.05%	07/01/2030	13,285	13,899,684	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.38%	04/15/2026	5,190	5,556,195	0.0
Kite Realty Group LP	4.00%	10/01/2026	2,785	2,901,157	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	4.63%	08/01/2029	9,147	9,207,799	0.1
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.25%	08/01/2026	13,581	13,903,185	0.1
Office Properties Income Trust	3.45%	10/15/2031	14,840	13,599,811	0.1
Omega Healthcare Investors, Inc.	4.50%	01/15/2025	3,865	4,027,360	0.0
Omega Healthcare Investors, Inc.	5.25%	01/15/2026	5,503	5,910,081	0.0
Realty Income Corp.	3.40%	01/15/2028	7,691	7,938,294	0.0
SITE Centers Corp.	3.63%	02/01/2025	13,265	13,608,973	0.1
SITE Centers Corp.	4.70%	06/01/2027	18,600	19,881,264	0.1
Spirit Realty LP	4.00%	07/15/2029	14,882	15,479,649	0.1
STORE Capital Corp.	4.63%	03/15/2029	4,573	4,908,797	0.0
				<u>130,822,249</u>	<u>0.7</u>
				<u>2,082,963,093</u>	<u>10.6</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Arconic Corp.	6.00%	05/15/2025	29,005	30,074,976	0.2
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043	5,949	6,412,209	0.0
CF Industries, Inc.	5.15%	03/15/2034	367	411,660	0.0
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044	14,821	16,724,185	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.40%	11/14/2034	9,609	10,914,792	0.1
Huntsman International LLC	4.50%	05/01/2029	13,936	14,781,997	0.1
MEGlobal Canada ULC	5.00%	05/18/2025	5,875	6,136,437	0.0
MEGlobal Canada ULC	5.88%	05/18/2030	3,112	3,531,731	0.0
Rohm & Haas Co.	7.85%	07/15/2029	22,000	28,858,004	0.1
				<u>117,845,991</u>	<u>0.6</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
General Electric Co., Series D(c)(d)	3.53%	06/15/2022	41,196	39,125,040	0.2
Owens Corning	7.00%	12/01/2036	1,449	1,905,518	0.0
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	4.40%	03/15/2024	12,188	12,626,597	0.1
				<u>53,657,155</u>	<u>0.3</u>
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Omnicom Group, Inc.	4.20%	06/01/2030	7,263	7,863,990	0.0
Time Warner Entertainment Co. LP	8.38%	07/15/2033	15,020	20,365,830	0.1
				<u>28,229,820</u>	<u>0.1</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
AT&T, Inc.	6.45%	06/15/2034	10,741	13,462,947	0.1
AT&T, Inc.	7.13%	12/15/2031	3,042	3,920,861	0.0
AT&T, Inc.	7.63%	04/15/2031	5,000	6,599,424	0.0
British Telecommunications PLC	5.13%	12/04/2028	10,440	11,293,615	0.1
British Telecommunications PLC	9.63%	12/15/2030	21,126	29,472,915	0.1
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC	4.74%	03/20/2025	11,574	11,947,653	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC	5.15%	03/20/2028	USD 9,140	\$ 9,827,741	0.0%
				<u>86,525,156</u>	<u>0.4</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
General Motors Co.	6.13%	10/01/2025	3,702	4,094,456	0.0
General Motors Co.	6.25%	10/02/2043	7,450	9,033,945	0.1
General Motors Co.	6.80%	10/01/2027	5,262	6,201,871	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	4.00%	10/06/2026	5,490	5,729,988	0.0
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	27,028	27,354,377	0.2
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030	10,754	10,807,186	0.1
Lear Corp.	3.80%	09/15/2027	6,784	7,072,151	0.0
Nissan Motor Co., Ltd.	4.35%	09/17/2027	20,699	21,264,029	0.1
				<u>91,558,003</u>	<u>0.5</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Genting New York LLC/GENNY Capital, Inc.	3.30%	02/15/2026	17,897	17,226,225	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.25%	06/01/2025	14,960	15,811,396	0.1
Marriott International, Inc./MD, Series EE	5.75%	05/01/2025	8,578	9,355,129	0.1
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	3,723	4,023,453	0.0
PulteGroup, Inc.	5.00%	01/15/2027	5,635	6,145,966	0.0
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	2,595	3,507,280	0.0
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	4.63%	04/06/2031	20,600	18,911,257	0.1
				<u>74,980,706</u>	<u>0.4</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
Ross Stores, Inc.	4.70%	04/15/2027	14,291	15,662,015	0.1
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Altria Group, Inc.	4.80%	02/14/2029	38,826	42,023,968	0.2
<b>ENERGIE</b>					
Boardwalk Pipelines LP	4.45%	07/15/2027	6,893	7,273,836	0.0
Boardwalk Pipelines LP	4.80%	05/03/2029	19,313	20,797,739	0.1
Boardwalk Pipelines LP	5.95%	06/01/2026	2,580	2,872,171	0.0
Cenovus Energy, Inc.	4.40%	04/15/2029	8,488	9,044,465	0.0
Cenovus Energy, Inc.	5.38%	07/15/2025	10,606	11,487,803	0.1
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	428	536,957	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	12,633	14,089,275	0.1
Enbridge Energy Partners LP	7.38%	10/15/2045	6,505	9,236,222	0.0
Energy Transfer LP	4.40%	03/15/2027	71,587	75,195,270	0.4
Energy Transfer LP	4.95%	05/15/2028	6,435	6,933,758	0.0
Energy Transfer LP	5.50%	06/01/2027	23,075	25,462,859	0.1
Energy Transfer LP	8.25%	11/15/2029	11,355	14,616,258	0.1
Eni SpA	4.25%	05/09/2029	12,712	13,482,062	0.1
Eni SpA, Series X-R	4.75%	09/12/2028	1,500	1,632,545	0.0
Hess Corp.	7.30%	08/15/2031	45,274	57,656,053	0.3
Hess Corp.	7.88%	10/01/2029	16,239	20,968,896	0.1
Kinder Morgan Energy Partners LP	7.30%	08/15/2033	9,000	11,543,801	0.1
Marathon Oil Corp.	4.40%	07/15/2027	1,500	1,592,726	0.0
Marathon Oil Corp.	6.80%	03/15/2032	10,144	12,478,950	0.1
ONEOK, Inc.	4.35%	03/15/2029	21,411	22,430,889	0.1
ONEOK, Inc.	5.85%	01/15/2026	33,260	37,023,890	0.2
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	9,649	10,288,791	0.1
Saudi Arabian Oil Co.	2.25%	11/24/2030	3,461	3,216,567	0.0
Suncor Energy, Inc.	7.15%	02/01/2032	12,130	15,522,770	0.1
Targa Resources Partners LP/ Targa Resources Partners Finance Corp.	6.50%	07/15/2027	15,917	16,869,281	0.1
Tennessee Gas Pipeline Co.	7.00%	10/15/2028	19,360	23,591,895	0.1
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	24,604	24,878,059	0.1
Western Midstream Operating LP	4.50%	03/01/2028	4,159	4,304,824	0.0
Western Midstream Operating LP	4.65%	07/01/2026	12,047	12,477,522	0.1
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	7,998	8,302,588	0.0
				<u>495,808,722</u>	<u>2.5</u>
<b>Dienstleistungen</b>					
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025	3,415	3,747,285	0.0
<b>Technologie</b>					
Broadcom, Inc.	3.14%	11/15/2035	2,915	2,701,326	0.0
Broadcom, Inc.	3.19%	11/15/2036	61,106	56,718,677	0.3
Broadcom, Inc.	4.11%	09/15/2028	10,043	10,555,075	0.1
Leidos, Inc.	7.13%	07/01/2032	2,000	2,496,196	0.0
				<u>72,471,274</u>	<u>0.4</u>
<b>Transportwesen – Fluggesellschaften</b>					
Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025	38,037	42,233,973	0.2
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	31,075	32,277,603	0.2
Mileage Plus Holdings LLC/ Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	59,148	62,405,035	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Southwest Airlines Co.....	5.25%	05/04/2025	USD 29,206	\$ 31,497,189	0.1%
				<u>168,413,800</u>	<u>0.8</u>
<b>TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN</b>					
BNSF Funding Trust I .....	6.61%	12/15/2055	5,597	6,030,478	0.0
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Aviation Capital Group LLC .....	4.13%	08/01/2025	117	120,152	0.0
Aviation Capital Group LLC .....	4.38%	01/30/2024	35,753	36,686,125	0.2
Aviation Capital Group LLC .....	4.88%	10/01/2025	4,985	5,224,693	0.0
Aviation Capital Group LLC .....	5.50%	12/15/2024	30,672	32,622,793	0.2
				<u>74,653,763</u>	<u>0.4</u>
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
NRG Energy, Inc.....	3.75%	06/15/2024	10,265	10,450,957	0.1
				<u>3,425,022,186</u>	<u>17.4</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Absa Group Ltd.(c) .....	6.38%	05/27/2026	4,093	4,000,908	0.0
Banco de Credito del Peru .....	3.13%	07/01/2030	20,748	19,617,234	0.1
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand.....	5.38%	04/17/2025	23,905	25,388,604	0.1
BBVA Bancomer SA/Texas .....	5.88%	09/13/2034	26,946	26,535,073	0.2
				<u>75,541,819</u>	<u>0.4</u>
<b>FINANZEN</b>					
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.....	4.75%	04/27/2027	400	386,000	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.....	5.50%	01/16/2025	39,399	39,497,497	0.2
				<u>39,883,497</u>	<u>0.2</u>
<b>SONSTIGE FINANZWERTE</b>					
OEC Finance Ltd.(b) .....	7.13%	12/26/2046	12,229	452,001	0.0
<b>REITS</b>					
Agile Group Holdings Ltd. ....	5.50%	05/17/2026	1,570	580,900	0.0
Agile Group Holdings Ltd. ....	6.05%	10/13/2025	565	209,050	0.0
Central China Real Estate Ltd.....	7.25%	04/24/2023	472	259,600	0.0
Central China Real Estate Ltd.....	7.25%	07/16/2024	687	309,150	0.0
Central China Real Estate Ltd.....	7.25%	08/13/2024	2,769	1,246,050	0.0
Central China Real Estate Ltd.....	7.50%	07/14/2025	2,060	906,400	0.0
Central China Real Estate Ltd.....	7.75%	05/24/2024	902	405,900	0.0
Central China Real Estate Ltd.....	7.90%	11/07/2023	214	100,580	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(e) .....	5.38%	09/13/2022	531	98,235	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(e) .....	5.88%	03/01/2027	5,486	960,050	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(e) .....	5.98%	08/18/2025	433	75,775	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(e) .....	7.95%	02/19/2023	913	164,340	0.0
China SCE Group Holdings Ltd.....	5.95%	09/29/2024	1,792	1,128,960	0.0
China SCE Group Holdings Ltd.....	6.00%	02/04/2026	2,671	1,495,760	0.1
China SCE Group Holdings Ltd.....	7.00%	05/02/2025	1,440	835,200	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e) .....	9.38%	06/30/2024	1,573	349,993	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e) .....	9.95%	07/23/2025	5,483	1,231,276	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e) .....	10.50%	01/15/2025	764	168,080	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e) .....	11.65%	06/01/2026	1,137	254,617	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e) .....	11.70%	11/11/2025	623	139,513	0.0
KWG Group Holdings Ltd. ....	5.95%	08/10/2025	1,942	776,800	0.0
KWG Group Holdings Ltd. ....	6.00%	08/14/2026	400	160,073	0.0
KWG Group Holdings Ltd. ....	7.40%	01/13/2027	694	274,130	0.0
Logan Group Co., Ltd.....	4.50%	01/13/2028	200	56,000	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd. ....	4.90%	05/13/2026	332	149,400	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd. ....	5.95%	04/30/2025	495	237,600	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd. ....	6.25%	08/10/2024	364	192,920	0.0
Ronshine China Holdings Ltd.....	6.75%	08/05/2024	698	153,560	0.0
Ronshine China Holdings Ltd.....	7.10%	01/25/2025	5,281	1,135,415	0.0
Ronshine China Holdings Ltd.....	8.10%	06/09/2023	1,772	434,140	0.0
Seazen Group Ltd. ....	4.45%	07/13/2025	2,260	1,197,800	0.0
Shimao Group Holdings Ltd.....	5.20%	01/16/2027	1,284	359,520	0.0
Shimao Group Holdings Ltd.....	5.60%	07/15/2026	270	78,300	0.0
Sunac China Holdings Ltd. ....	5.95%	04/26/2024	1,297	505,830	0.0
Sunac China Holdings Ltd. ....	6.50%	01/10/2025	2,260	858,800	0.0
Sunac China Holdings Ltd. ....	6.50%	01/26/2026	1,087	407,625	0.0
Sunac China Holdings Ltd. ....	6.65%	08/03/2024	282	108,570	0.0
Sunac China Holdings Ltd. ....	6.80%	10/20/2024	724	278,740	0.0
Sunac China Holdings Ltd. ....	7.00%	07/09/2025	316	120,080	0.0
Times China Holdings Ltd. ....	5.55%	06/04/2024	2,235	871,650	0.0
Times China Holdings Ltd. ....	5.75%	01/14/2027	1,726	586,840	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Times China Holdings Ltd. ....	6.60%	03/02/2023	USD 490	\$ 220,500	0.0%
Times China Holdings Ltd. ....	6.75%	07/08/2025	703	253,080	0.0
Trust Fibra Uno .....	4.87%	01/15/2030	29,764	29,336,142	0.2
Yango Justice International Ltd. ....	7.50%	04/15/2024	727	92,147	0.0
Yango Justice International Ltd. ....	7.50%	02/17/2025	7,372	958,360	0.0
Yango Justice International Ltd. ....	7.88%	09/04/2024	3,012	391,560	0.0
Yango Justice International Ltd. ....	8.25%	11/25/2023	1,343	174,590	0.0
Yango Justice International Ltd. ....	9.25%	04/15/2023	630	81,900	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd. ....	6.35%	01/13/2027	3,443	550,880	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd. ....	7.38%	01/13/2026	623	108,168	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd. ....	7.70%	02/20/2025	200	32,000	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd. ....	7.85%	08/12/2026	2,611	417,760	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd. ....	8.38%	10/30/2024	444	71,040	0.0
Zhenro Properties Group Ltd. ....	6.63%	01/07/2026	5,337	587,070	0.0
Zhenro Properties Group Ltd. ....	6.70%	08/04/2026	574	63,140	0.0
Zhenro Properties Group Ltd. ....	7.10%	09/10/2024	587	69,503	0.0
Zhenro Properties Group Ltd. ....	7.35%	02/05/2025	509	55,990	0.0
				<u>53,327,052</u>	<u>0.3</u>
				<u>169,204,369</u>	<u>0.9</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Anglo American Capital PLC .....	5.63%	04/01/2030	40,450	45,437,991	0.2
Braskem Idesa SAPI .....	6.99%	02/20/2032	16,025	15,303,875	0.1
Braskem Idesa SAPI .....	7.45%	11/15/2029	4,456	4,424,808	0.0
Braskem Netherlands Finance BV .....	4.50%	01/31/2030	20,153	19,850,705	0.1
CSN Inova Ventures .....	6.75%	01/28/2028	11,082	11,502,526	0.1
CSN Resources SA .....	4.63%	06/10/2031	24,154	21,875,070	0.1
Eldorado Gold Corp. ....	6.25%	09/01/2029	12,403	12,403,000	0.1
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd. ....	5.13%	05/15/2024	8,685	8,936,322	0.1
GUSAP III LP .....	4.25%	01/21/2030	9,269	9,212,784	0.1
HTA Group Ltd./Mauritius .....	7.00%	12/18/2025	20,951	21,160,510	0.1
Indika Energy Capital IV Pte Ltd. ....	8.25%	10/22/2025	22,865	22,407,700	0.1
Industrias Penoles SAB de CV .....	5.65%	09/12/2049	4,016	4,276,538	0.0
Nexa Resources SA .....	5.38%	05/04/2027	16,701	16,859,659	0.1
OCP SA .....	3.75%	06/23/2031	6,361	5,573,826	0.0
Sasol Financing USA LLC. ....	5.88%	03/27/2024	8,684	8,822,944	0.1
Stillwater Mining Co. ....	4.00%	11/16/2026	5,644	5,404,130	0.0
Stillwater Mining Co. ....	4.50%	11/16/2029	5,188	4,772,960	0.0
Suzano Austria GmbH .....	5.00%	01/15/2030	6,570	6,723,163	0.0
Suzano Austria GmbH .....	7.00%	03/16/2047	2,823	3,214,691	0.0
Vedanta Resources Finance II PLC .....	8.95%	03/11/2025	20,226	19,012,727	0.1
Volcan Cia Minera SAA. ....	4.38%	02/11/2026	4,160	3,951,480	0.0
				<u>271,127,409</u>	<u>1.4</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Cemex SAB de CV(c) .....	5.13%	06/08/2026	16,029	15,307,695	0.1
Cemex SAB de CV .....	7.38%	06/05/2027	6,522	6,970,714	0.0
Embraer Netherlands Finance BV .....	5.40%	02/01/2027	26,107	26,058,049	0.1
Embraer Netherlands Finance BV .....	6.95%	01/17/2028	14,202	14,759,428	0.1
IHS Holding Ltd. ....	5.63%	11/29/2026	6,475	6,329,313	0.0
IHS Holding Ltd. ....	6.25%	11/29/2028	2,727	2,652,008	0.0
Klabina Austria GmbH .....	7.00%	04/03/2049	3,731	3,842,930	0.0
Usiminas International SARL .....	5.88%	07/18/2026	11,294	11,551,503	0.1
				<u>87,471,640</u>	<u>0.4</u>
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Globo Comunicacao e Participacoes SA .....	4.88%	01/22/2030	8,603	7,664,241	0.0
Prosus NV .....	4.03%	08/03/2050	7,314	5,668,350	0.0
VTR Finance NV .....	6.38%	07/15/2028	3,891	3,910,455	0.0
Weibo Corp. ....	3.50%	07/05/2024	28,740	29,077,695	0.2
				<u>46,320,741</u>	<u>0.2</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
C&W Senior Financing DAC .....	6.88%	09/15/2027	21,849	22,588,828	0.1
CT Trust .....	5.13%	02/03/2032	2,965	2,972,585	0.0
				<u>25,561,413</u>	<u>0.1</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
Falabella SA. ....	3.75%	10/30/2027	8,500	8,562,687	0.0
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
BRF SA .....	4.88%	01/24/2030	27,471	26,085,775	0.2
Central American Bottling Corp./CBC Bottling Holdco SL/ Beliv Holdco SL .....	5.25%	04/27/2029	2,894	2,931,043	0.0
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV .....	2.43%	07/01/2031	10,259	9,367,749	0.0
NBM US Holdings, Inc. ....	6.63%	08/06/2029	10,000	10,564,375	0.1
Ulker Biskuvi Sanayi AS .....	6.95%	10/30/2025	3,907	3,569,533	0.0
				<u>52,518,475</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ENERGIE</b>					
Ecopetrol SA	4.63%	11/02/2031	USD 5,838	\$ 5,220,632	0.0%
Ecopetrol SA	5.88%	11/02/2051	7,071	5,930,448	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	24,762	25,863,909	0.1
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	6,267	6,169,168	0.0
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	4,306	3,909,399	0.0
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	2,624	2,633,840	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028	1,939	1,879,974	0.0
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	11,154	11,488,620	0.1
Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026	4,339	4,371,543	0.0
Medco Platinum Road Pte Ltd.	6.75%	01/30/2025	18,656	18,735,288	0.1
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	11,009	10,665,285	0.1
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	8,487	8,016,502	0.0
Peru LNG Srl	5.38%	03/22/2030	11,304	9,755,352	0.1
Petrobras Global Finance BV	7.38%	01/17/2027	33,486	37,462,462	0.2
Petrobras Global Finance BV	8.75%	05/23/2026	14,377	16,868,714	0.1
Raizen Fuels Finance SA	5.30%	01/20/2027	16,179	16,845,170	0.1
SEPLAT Energy PLC	7.75%	04/01/2026	11,120	10,842,000	0.1
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	06/15/2028	5,998	5,449,243	0.0
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026	25,480	25,007,027	0.1
				<u>227,114,576</u>	<u>1.1</u>
<b>DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Bidvest Group UK PLC (The)	3.63%	09/23/2026	9,421	8,997,055	0.1
StoneCo Ltd.	3.95%	06/16/2028	4,218	3,344,874	0.0
				<u>12,341,929</u>	<u>0.1</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	345	349,147	0.0
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	26,695	26,728,368	0.2
NXP BV/NXP Funding LLC	5.35%	03/01/2026	21,052	23,095,360	0.1
NXP BV/NXP Funding LLC	5.55%	12/01/2028	1,500	1,708,875	0.0
				<u>51,881,750</u>	<u>0.3</u>
<b>TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN</b>					
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	4,462	4,500,930	0.0
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	9,363	10,247,892	0.1
				<u>14,748,822</u>	<u>0.1</u>
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	10,939	10,037,626	0.1
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.00%	07/30/2027	23,925	23,660,330	0.1
JSW Infrastructure Ltd.	4.95%	01/21/2029	3,094	2,997,893	0.0
				<u>36,695,849</u>	<u>0.2</u>
				<u>834,345,291</u>	<u>4.2</u>
<b>STAATSANLEIHEN</b>					
<b>ANGOLA</b>					
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	17,946	17,631,945	0.1
Angolan Government International Bond	9.50%	11/12/2025	12,861	13,761,270	0.0
				<u>31,393,215</u>	<u>0.1</u>
<b>BRASILIEN</b>					
Brazilian Government International Bond	8.25%	01/20/2034	15,326	19,107,691	0.1
<b>KOLUMBIEN</b>					
Colombia Government International Bond	3.13%	04/15/2031	4,454	3,775,600	0.0
Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	47,384	39,660,408	0.2
Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	11,769	10,557,529	0.1
Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	29,991	28,984,427	0.1
Colombia Government International Bond	7.38%	09/18/2037	9,114	10,101,160	0.1
				<u>93,079,124</u>	<u>0.5</u>
<b>COSTA RICA</b>					
Costa Rica Government International Bond	4.25%	01/26/2023	9,155	9,251,127	0.1
Costa Rica Government International Bond	4.38%	04/30/2025	5,510	5,586,796	0.0
				<u>14,837,923</u>	<u>0.1</u>
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>					
Dominican Republic International Bond	4.50%	01/30/2030	75,271	69,428,089	0.4
Dominican Republic International Bond	4.88%	09/23/2032	19,203	17,448,326	0.1
Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028	8,000	8,254,000	0.0
Dominican Republic International Bond	6.88%	01/29/2026	45,042	49,095,780	0.2
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	2,096	2,352,760	0.0
				<u>146,578,955</u>	<u>0.7</u>
<b>ECUADOR</b>					
Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	3,678	2,162,883	0.0
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2040	9,839	6,120,232	0.0
Ecuador Government International Bond	1.00%	07/31/2035	26,864	18,944,214	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Ecuador Government International Bond	5.00%	07/31/2030	USD 12,724	\$ 11,191,901	0.1%
				<u>38,419,230</u>	<u>0.2</u>
ÄGYPTEN					
Egypt Government International Bond	4.55%	11/20/2023	6,150	6,150,000	0.0
Egypt Government International Bond	5.75%	05/29/2024	62,050	61,584,625	0.3
Egypt Government International Bond	6.59%	02/21/2028	9,640	8,579,600	0.1
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	6,969	5,662,312	0.0
Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	64,615	62,030,400	0.3
Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	62,112	51,863,520	0.3
				<u>195,870,457</u>	<u>1.0</u>
EL SALVADOR					
El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	23,539	14,179,305	0.1
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	15,000	8,191,875	0.1
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	9,532	4,651,616	0.0
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	13,501	7,385,891	0.0
				<u>34,408,687</u>	<u>0.2</u>
GHANA					
Ghana Government International Bond	6.38%	02/11/2027	53,977	37,109,187	0.2
Ghana Government International Bond	7.75%	04/07/2029	12,555	8,506,012	0.1
Ghana Government International Bond	7.88%	03/26/2027	34,165	24,427,975	0.1
Ghana Government International Bond	8.13%	01/18/2026	7,000	5,425,000	0.0
Ghana Government International Bond	8.13%	03/26/2032	7,000	4,690,000	0.0
Ghana Government International Bond	8.63%	04/07/2034	10,289	6,816,463	0.1
Ghana Government International Bond	10.75%	10/14/2030	4,326	4,196,220	0.0
				<u>91,170,857</u>	<u>0.5</u>
HONDURAS					
Honduras Government International Bond	6.25%	01/19/2027	12,127	10,920,364	0.1
ELFENBEINKÜSTE					
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	18,113	17,431,498	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	39,769	40,696,115	0.2
				<u>58,127,613</u>	<u>0.3</u>
KENIA					
Republic of Kenya Government International Bond	6.88%	06/24/2024	10,777	11,154,195	0.0
Republic of Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	19,297	18,428,635	0.1
Republic of Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028	11,890	11,236,050	0.1
				<u>40,818,880</u>	<u>0.2</u>
MEXIKO					
Mexico Government International Bond	4.75%	04/27/2032	15,488	16,525,696	0.1
NIGERIA					
Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	7,834	7,225,886	0.0
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	67,881	64,486,950	0.3
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/21/2025	50,425	53,450,500	0.3
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	13,971	11,281,582	0.1
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	12,210	10,317,450	0.1
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	5,591	5,136,731	0.0
				<u>151,899,099</u>	<u>0.8</u>
PAKISTAN					
Pakistan Government International Bond	6.00%	04/08/2026	12,053	10,999,688	0.0
Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	589	544,752	0.0
Pakistan Government International Bond	7.38%	04/08/2031	19,018	16,310,027	0.1
				<u>27,854,467</u>	<u>0.1</u>
PANAMA					
Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026	32,190	32,970,607	0.2
PERU					
Peruvian Government International Bond	2.39%	01/23/2026	1,120	1,094,310	0.0
Peruvian Government International Bond	2.78%	01/23/2031	3,069	2,909,412	0.0
				<u>4,003,722</u>	<u>0.0</u>
SENEGAL					
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	43,004	39,671,190	0.2
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	36,542	30,804,906	0.1
				<u>70,476,096</u>	<u>0.3</u>
SÜDAFRIKA					
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	45,168	38,895,294	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	6.30%	06/22/2048	14,391	13,431,300	0.1
				<u>52,326,594</u>	<u>0.3</u>
UKRAINE					
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2033	56,094	17,950,080	0.1
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2032	68,051	21,776,320	0.1
Ukraine Government International Bond	8.99%	02/01/2024	10,000	3,400,000	0.0
				<u>43,126,400</u>	<u>0.2</u>



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>URUGUAY</b>					
Uruguay Government International Bond . . . . .	7.63%	03/21/2036	USD 7,989	\$ 11,383,490	0.0%
Uruguay Government International Bond . . . . .	7.88%	01/15/2033	11,680	16,208,403	0.1
				27,591,893	0.1
				<u>1,201,507,570</u>	<u>6.1</u>
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
Adani Transmission Ltd. . . . .	4.00%	08/03/2026	15,853	16,073,951	0.1
AES Andes SA . . . . .	6.35%	10/07/2079	12,300	12,315,375	0.1
AES Panama Generation Holdings SRL . . . . .	4.38%	05/31/2030	11,919	11,503,027	0.1
Chile Electricity PEC SpA . . . . .	0.00%	01/25/2028	5,495	4,029,552	0.0
Consorcio Transmantaro SA . . . . .	4.38%	05/07/2023	30,911	31,336,026	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP . . . . .	4.25%	07/18/2029	24,989	22,072,159	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP . . . . .	4.38%	02/15/2031	19,852	17,262,555	0.1
India Clean Energy Holdings . . . . .	4.50%	04/18/2027	13,448	12,741,980	0.1
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV . . . . .	3.75%	01/14/2028	7,817	7,859,994	0.0
JSW Hydro Energy Ltd. . . . .	4.13%	05/18/2031	314	289,319	0.0
Kallpa Generacion SA . . . . .	4.13%	08/16/2027	10,259	10,145,510	0.1
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA . . . . .	4.38%	06/18/2026	9,592	9,086,502	0.0
LLPL Capital Pte Ltd. . . . .	6.88%	02/04/2039	9,688	10,147,046	0.0
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. . . . .	6.75%	04/24/2033	11,953	12,687,524	0.1
				<u>177,550,520</u>	<u>0.9</u>
				<u>2,382,607,750</u>	<u>12.1</u>
<b>BEHÖRDEN</b>					
<b>SCHULDVERSCHREIBUNGEN VON BEHÖRDEN</b>					
Federal Home Loan Banks . . . . .	3.25%	06/09/2028	34,000	36,577,215	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. . . . .	6.25%	07/15/2032	119,285	164,875,566	0.8
Federal Home Loan Mortgage Corp. . . . .	6.75%	03/15/2031	65,181	89,950,005	0.4
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series GDIF . . . . .	6.75%	09/15/2029	8,750	11,759,684	0.1
Federal National Mortgage Association . . . . .	6.25%	05/15/2029	120,037	154,318,409	0.8
Federal National Mortgage Association . . . . .	6.63%	11/15/2030	358,671	486,255,339	2.5
Federal National Mortgage Association . . . . .	7.13%	01/15/2030	142,912	196,206,899	1.0
Federal National Mortgage Association . . . . .	7.25%	05/15/2030	15,000	20,872,133	0.1
Tennessee Valley Authority . . . . .	7.13%	05/01/2030	19,383	26,578,926	0.1
				<u>1,187,394,176</u>	<u>6.0</u>
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-1A, Class B1(d) . . . . .	4.44%	04/25/2028	2,270	2,248,426	0.0
Series 2018-3A, Class M1B(d) . . . . .	2.04%	10/25/2028	4,778	4,762,468	0.0
Series 2019-1A, Class M2(d) . . . . .	2.89%	03/25/2029	13,043	12,899,817	0.1
Series 2019-2A, Class M1C(d) . . . . .	2.19%	04/25/2029	51,941	51,782,878	0.3
Series 2019-2A, Class M2(d) . . . . .	3.29%	04/25/2029	5,000	4,943,307	0.0
Series 2019-4A, Class M1B(d) . . . . .	2.19%	10/25/2029	2,782	2,781,664	0.0
Series 2019-4A, Class M1C(d) . . . . .	2.69%	10/25/2029	25,958	25,666,612	0.1
Series 2019-4A, Class M2(d) . . . . .	3.04%	10/25/2029	40,849	40,101,737	0.2
Series 2020-3A, Class M2(d) . . . . .	5.04%	10/25/2030	4,250	4,410,006	0.0
Eagle RE Ltd., Series 2018-1, Class M1(d) . . . . .	1.89%	11/25/2028	2,145	2,141,057	0.0
Eagle Re Ltd.					
Series 2019-1, Class M1B(d) . . . . .	1.99%	04/25/2029	1,278	1,270,225	0.0
Series 2019-1, Class M2(d) . . . . .	3.49%	04/25/2029	5,236	5,240,689	0.0
Series 2020-1, Class M2(d) . . . . .	2.19%	01/25/2030	15,704	15,138,419	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit					
Risk Debt Notes					
Series 2014-DN4, Class M3(d) . . . . .	4.74%	10/25/2024	7,807	7,925,396	0.0
Series 2014-HQ1, Class M3(d) . . . . .	4.29%	08/25/2024	974	976,452	0.0
Series 2014-HQ2, Class M3(d) . . . . .	3.94%	09/25/2024	1,683	1,725,811	0.0
Series 2014-HQ3, Class M3(d) . . . . .	4.94%	10/25/2024	72	72,240	0.0
Series 2015-HQA1, Class M3(d) . . . . .	4.89%	03/25/2028	14,770	15,079,316	0.1
Series 2015-HQA2, Class M3(d) . . . . .	4.99%	05/25/2028	15,206	15,585,556	0.1
Series 2016-HQA3, Class M3(d) . . . . .	4.04%	03/25/2029	2,388	2,440,883	0.0
Series 2019-DNA2, Class M2(d) . . . . .	2.64%	03/25/2049	24,850	25,013,178	0.1
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2013-C01, Class M2(d) . . . . .	5.44%	10/25/2023	1,757	1,827,612	0.0
Series 2014-C01, Class M2(d) . . . . .	4.59%	01/25/2024	1,339	1,392,195	0.0
Series 2014-C03, Class 2M2(d) . . . . .	3.09%	07/25/2024	531	535,061	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(d) . . . . .	5.09%	11/25/2024	9,006	9,331,096	0.1
Series 2014-C04, Class 2M2(d) . . . . .	5.19%	11/25/2024	795	803,777	0.0
Series 2015-C02, Class 2M2(d) . . . . .	4.19%	05/25/2025	179	178,920	0.0
Series 2015-C03, Class 2M2(d) . . . . .	5.19%	07/25/2025	242	241,831	0.0
Series 2015-C04, Class 1M2(d) . . . . .	5.89%	04/25/2028	47,587	50,199,301	0.3
Series 2015-C04, Class 2M2(d) . . . . .	5.74%	04/25/2028	26,593	28,110,146	0.1
Series 2016-C01, Class 1M2(d) . . . . .	6.94%	08/25/2028	13,166	13,802,558	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2016-C01, Class 2M2(d)	7.14%	08/25/2028	USD 9,165	\$ 9,677,997	0.1%
Series 2016-C02, Class 1M2(d)	6.19%	09/25/2028	27,488	28,473,699	0.1
Series 2016-C03, Class 1M2(d)	5.49%	10/25/2028	15,078	15,678,137	0.1
Series 2016-C06, Class 1M2(d)	4.44%	04/25/2029	22,784	23,542,669	0.1
Series 2016-C07, Class 2M2(d)	4.54%	05/25/2029	15,329	15,959,333	0.1
Series 2017-C01, Class 1M2(d)	3.74%	07/25/2029	20,397	20,919,884	0.1
Series 2017-C03, Class 1B1(d)	5.04%	10/25/2029	10,420	10,945,132	0.1
Home Re Ltd.					
Series 2018-1, Class M1(d)	1.79%	10/25/2028	5,641	5,632,446	0.0
Series 2018-1, Class M2(d)	3.19%	10/25/2028	1,062	1,057,543	0.0
Series 2019-1, Class M2(d)	3.44%	05/25/2029	5,400	5,421,359	0.0
Oaktown Re II Ltd., Series 2018-1A, Class M1(d)	1.74%	07/25/2028	380	379,596	0.0
Oaktown Re V Ltd., Series 2020-2A, Class M2(d)	5.44%	10/25/2030	4,014	4,009,196	0.0
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2019-3R, Class A(d)	2.81%	10/27/2022	6,387	6,377,596	0.0
Radnor Re Ltd.					
Series 2018-1, Class M2(d)	2.89%	03/25/2028	9,240	9,205,822	0.1
Series 2019-1, Class M1B(d)	2.14%	02/25/2029	12,742	12,758,406	0.1
Series 2019-1, Class M2(d)	3.39%	02/25/2029	12,181	12,100,704	0.1
Series 2019-2, Class M1B(d)	1.94%	06/25/2029	21,313	21,289,011	0.1
Traingle Re Ltd., Series 2020-1, Class M1C(d)	4.69%	10/25/2030	19,080	19,173,952	0.1
				571,231,116	2.9
<b>VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE</b>					
Bellemeade Re Ltd., Series 2019-3A, Class MIC(d)	2.14%	07/25/2029	69,349	68,897,607	0.4
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 3119, Class PI(d)(f)	7.01%	02/15/2036	4,120	952,847	0.0
Series 3725, Class CS(d)(f)	5.81%	05/15/2040	24,334	2,818,409	0.0
Series 3898, Class NS(d)(f)	5.74%	07/15/2041	6,362	962,659	0.0
Series 3921, Class SB(d)(f)	6.37%	09/15/2041	13,427	2,672,380	0.0
Series 3928, Class SE(d)(f)	6.39%	09/15/2041	12,049	2,377,772	0.0
Series 4125, Class SA(d)(f)	5.96%	11/15/2042	7,741	1,382,738	0.0
Series 4248, Class SL(d)(f)	5.86%	05/15/2041	2,289	334,596	0.0
Series 4292, Class S(d)(f)	5.86%	01/15/2044	2,898	537,000	0.0
Series 4317, Class SD(d)(f)	7.01%	08/15/2035	7,119	1,456,468	0.0
Series 4372, Class JS(d)(f)	5.91%	08/15/2044	17,253	2,960,887	0.0
Series 4373, Class SA(d)(f)	5.96%	08/15/2044	10,842	1,967,822	0.0
Series 4494, Class SL(d)(f)	6.03%	07/15/2045	35,131	6,634,001	0.1
Series 4495, Class SA(d)(f)	5.96%	07/15/2045	8,093	1,479,791	0.0
Series 4570, Class ST(d)(f)	5.81%	04/15/2046	9,309	1,705,032	0.0
Series 4585, Class DS(d)(f)	5.81%	05/15/2046	17,651	3,240,162	0.0
Series 4593, Class SA(d)(f)	5.81%	06/15/2046	12,039	2,173,049	0.0
Series 4656, Class SK(d)(f)	5.86%	02/15/2047	9,377	1,619,473	0.0
Series 4707, Class LS(d)(f)	5.96%	08/15/2047	11,523	1,819,874	0.0
Series 4719, Class SA(d)(f)	5.96%	09/15/2047	9,539	1,715,242	0.0
Series 4719, Class SB(d)(f)	5.96%	09/15/2047	18,609	3,398,702	0.0
Series 4727, Class AS(d)(f)	6.01%	11/15/2047	15,528	2,764,931	0.0
Series 4735, Class SA(d)(f)	6.01%	12/15/2047	27,871	5,278,870	0.1
Series 4736, Class LS(d)(f)	6.01%	12/15/2047	12,308	2,523,710	0.0
Series 4736, Class SM(d)(f)	6.01%	12/15/2047	25,036	4,733,943	0.1
Series 4754, Class QS(d)(f)	5.96%	02/15/2048	15,490	2,582,152	0.0
Series 4767, Class SB(d)(f)	6.01%	03/15/2048	6,522	1,040,677	0.0
Series 4824, Class KS(d)(f)	6.01%	09/15/2048	6,019	973,071	0.0
Series 4906, Class SA(d)(f)	5.86%	09/25/2049	31,292	5,277,649	0.1
Series 4906, Class SN(d)(f)	5.86%	09/25/2049	24,640	4,418,792	0.0
Series 4927, Class SJ(d)(f)	5.86%	11/25/2049	18,568	3,845,241	0.0
Series 4932, Class SM(d)(f)	5.86%	06/25/2049	29,946	4,606,350	0.1
Series 4954, Class SL(d)(f)	5.86%	02/25/2050	321	54,761	0.0
Series 4981, Class HS(d)(f)	5.91%	06/25/2050	87,098	13,931,481	0.1
Series 4981, Class JS(d)(f)	5.91%	06/25/2050	137,397	24,742,397	0.2
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2005-58, Class IK(d)(f)	5.81%	07/25/2035	7,796	1,529,665	0.0
Series 2006-8, Class JH(d)(f)	6.41%	03/25/2036	9,984	2,040,076	0.0
Series 2011-146, Class SA(d)(f)	5.81%	01/25/2042	9,510	1,708,269	0.0
Series 2012-122, Class LS(d)(f)	5.91%	11/25/2042	8,481	1,817,313	0.0
Series 2012-122, Class MS(d)(f)	5.91%	11/25/2042	9,405	1,985,434	0.0
Series 2012-17, Class ES(d)(f)	6.36%	03/25/2041	1,477	137,130	0.0
Series 2012-17, Class SE(d)(f)	5.76%	03/25/2042	8,591	1,962,516	0.0
Series 2012-7, Class QS(d)(f)	5.81%	02/25/2042	12,039	2,166,706	0.0
Series 2012-70, Class HS(d)(f)	5.81%	07/25/2042	14,245	2,577,752	0.0
Series 2013-15, Class SA(d)(f)	5.96%	03/25/2043	7,684	1,487,374	0.0
Series 2013-4, Class ST(d)(f)	5.96%	02/25/2043	8,076	1,503,194	0.0
Series 2013-62, Class SA(d)(f)	6.51%	06/25/2043	12,060	2,756,243	0.0
Series 2014-17, Class SB(d)(f)	5.86%	04/25/2044	9,314	1,781,132	0.0
Series 2014-28, Class SB(d)(f)	5.86%	05/25/2044	8,728	1,846,101	0.0
Series 2014-35, Class CS(d)(f)	5.96%	06/25/2044	13,575	2,053,724	0.0
Series 2014-40, Class HS(d)(f)	6.51%	07/25/2044	5,938	1,470,250	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2014-78, Class SA(d)(f) .....	5.91%	12/25/2044	USD 4,867	\$ 979,089	0.0%
Series 2014-88, Class BS(d)(f) .....	5.96%	01/25/2045	8,185	1,461,866	0.0
Series 2015-26, Class SH(d)(f) .....	6.26%	05/25/2045	12,190	2,485,026	0.0
Series 2015-57, Class AS(d)(f) .....	6.06%	08/25/2045	46,840	7,214,815	0.1
Series 2015-90, Class SL(d)(f) .....	5.96%	12/25/2045	10,439	1,951,237	0.0
Series 2016-29, Class SA(d)(f) .....	5.81%	05/25/2046	11,838	2,052,008	0.0
Series 2016-60, Class SA(d)(f) .....	5.91%	09/25/2046	28,673	4,309,943	0.0
Series 2016-64, Class BI(g) .....	5.00%	09/25/2046	26,396	4,034,171	0.0
Series 2016-65, Class AS(d)(f) .....	5.91%	09/25/2046	12,686	2,117,162	0.0
Series 2016-89, Class SH(d)(f) .....	5.81%	12/25/2046	6,350	1,154,915	0.0
Series 2017-105, Class SE(d)(f) .....	5.96%	01/25/2048	42,860	7,812,842	0.1
Series 2017-109, Class SJ(d)(f) .....	6.01%	01/25/2048	3,808	646,112	0.0
Series 2017-112, Class SA(d)(f) .....	5.96%	01/25/2048	12,009	2,042,876	0.0
Series 2017-20, Class SJ(d)(f) .....	5.91%	04/25/2047	26,753	4,719,453	0.1
Series 2017-26, Class TS(d)(f) .....	5.76%	04/25/2047	8,801	1,618,920	0.0
Series 2017-35, Class LS(d)(f) .....	5.96%	05/25/2047	28,503	5,308,489	0.1
Series 2017-38, Class SE(d)(f) .....	6.01%	05/25/2047	10,797	917,581	0.0
Series 2017-38, Class SE(d)(f) .....	5.91%	05/25/2047	19,997	3,411,564	0.0
Series 2017-49, Class SP(d)(f) .....	5.96%	07/25/2047	8,114	1,461,416	0.0
Series 2017-81, Class CS(d)(f) .....	6.01%	10/25/2047	9,180	1,833,813	0.0
Series 2017-85, Class HS(d)(f) .....	6.01%	11/25/2047	14,463	2,664,732	0.0
Series 2018-13, Class SG(d)(f) .....	5.96%	03/25/2048	8,218	1,566,245	0.0
Series 2018-28, Class PS(d)(f) .....	6.01%	05/25/2048	15,454	2,583,826	0.0
Series 2018-28, Class SB(d)(f) .....	6.01%	05/25/2048	15,582	2,712,062	0.0
Series 2018-30, Class SA(d)(f) .....	6.01%	05/25/2048	15,625	2,400,467	0.0
Series 2018-32, Class SB(d)(f) .....	6.01%	05/25/2048	15,399	2,805,749	0.0
Series 2018-39, Class AS(d)(f) .....	6.01%	06/25/2048	7,605	1,650,451	0.0
Series 2018-45, Class SL(d)(f) .....	6.01%	06/25/2048	11,381	2,684,524	0.0
Series 2018-47, Class SD(d)(f) .....	6.01%	07/25/2048	24,108	4,283,038	0.0
Series 2018-63, Class KS(d)(f) .....	6.01%	09/25/2048	6,616	1,099,388	0.0
Series 2018-96, Class SC(d)(f) .....	5.86%	10/25/2035	6,314	939,474	0.0
Series 2019-13, Class SA(d)(f) .....	5.81%	04/25/2049	13,950	2,173,587	0.0
Series 2019-25, Class SA(d)(f) .....	5.86%	06/25/2049	34,312	6,499,479	0.1
Series 2019-31, Class SJ(d)(f) .....	5.91%	07/25/2049	7,057	1,283,132	0.0
Series 2019-37, Class US(d)(f) .....	5.86%	07/25/2049	12,519	1,798,791	0.0
Series 2019-38, Class SM(d)(f) .....	5.86%	07/25/2049	6,915	1,454,584	0.0
Series 2019-42, Class SQ(d)(f) .....	5.86%	08/25/2049	21,661	3,904,150	0.0
Series 2019-48, Class SA(d)(f) .....	6.01%	12/25/2039	25,132	5,415,114	0.1
Series 2019-48, Class SM(d)(f) .....	5.86%	07/25/2039	9,346	2,079,652	0.0
Series 2019-60, Class SJ(d)(f) .....	5.86%	10/25/2049	21,902	3,963,147	0.0
Series 2019-65, Class SY(d)(f) .....	5.86%	11/25/2049	14,438	2,797,264	0.0
<b>Government National Mortgage Association</b>					
Series 2014-160, Class SP(d)(f) .....	5.44%	10/20/2044	14,354	2,605,405	0.0
Series 2017-103, Class SL(d)(f) .....	6.04%	07/20/2047	18,189	2,875,384	0.0
Series 2017-115, Class SA(d)(f) .....	6.04%	07/20/2047	13,769	2,965,081	0.0
Series 2017-122, Class SA(d)(f) .....	6.04%	08/20/2047	17,474	2,765,159	0.0
Series 2017-134, Class SE(d)(f) .....	6.04%	09/20/2047	8,066	1,180,990	0.0
Series 2017-149, Class SG(d)(f) .....	6.04%	10/20/2047	12,950	2,330,625	0.0
Series 2017-52, Class SN(d)(f) .....	5.99%	04/20/2047	5,209	825,153	0.0
Series 2020-47, Class SG(d)(f) .....	5.84%	02/20/2049	16,319	2,552,640	0.0
<b>Oaktown Re III Ltd.</b>					
Series 2019-1A, Class M1B(d) .....	2.14%	07/25/2029	3,141	3,126,590	0.0
Series 2019-1A, Class M2(d) .....	2.74%	07/25/2029	23,910	23,486,195	0.1
<b>Radnor Re Ltd.</b>					
Series 2020-1, Class M1B(d) .....	1.64%	01/25/2030	22,546	22,095,130	0.1
Series 2020-1, Class M1C(d) .....	1.94%	01/25/2030	8,262	7,947,798	0.1
				405,751,719	2.1
<b>FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE</b>					
<b>Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs</b>					
Series 4398, Class IO(g) .....	6.00%	10/15/2037	14,468	2,921,534	0.0
Series 4913, Class IO(g) .....	6.00%	04/15/2041	6,762	1,580,585	0.0
Series 4933, Class IO(g) .....	5.00%	03/15/2049	8,223	1,365,090	0.0
Series 4976, Class MI(g) .....	4.50%	05/25/2050	36,947	6,779,704	0.1
Series 4981, Class MI(g) .....	5.00%	06/25/2050	56,153	10,595,202	0.1
Series 4987, Class IC(g) .....	4.50%	06/25/2050	132,927	20,440,765	0.1
Series 4993, Class LI(g) .....	5.00%	07/25/2050	16,545	2,476,238	0.0
Series 5008, Class AI(g) .....	3.50%	09/25/2050	16,661	2,595,089	0.0
Series 5011, Class MI(g) .....	3.00%	09/25/2050	16,013	2,531,249	0.0
Series 5013, Class JI(g) .....	4.00%	09/25/2050	29,457	3,956,345	0.0
Series 5015, Class BI(g) .....	4.00%	09/25/2050	23,194	3,846,455	0.0
Series 5018, Class AI(g) .....	4.00%	10/25/2050	12,180	2,138,584	0.0
Series 5018, Class GI(g) .....	4.50%	10/25/2050	20,272	3,281,693	0.0
Series 5024, Class DI(g) .....	4.00%	10/25/2050	5,905	964,272	0.0
Series 5030, Class EI(g) .....	3.50%	10/25/2050	5,778	1,098,609	0.0
Series 5036, Class IT(g) .....	4.00%	03/25/2050	8,022	1,301,832	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 5040, Class AI(g)	3.50%	11/25/2050	USD 2,377	\$ 394,038	0.0%
Series 5043, Class IO(g)	5.00%	11/25/2050	17,473	3,538,337	0.0
Series 5049, Class CI(g)	3.50%	12/25/2050	27,296	3,938,529	0.0
Series 5052, Class IK(g)	4.00%	12/25/2050	24,529	4,044,653	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2010-109, Class IM(g)	5.50%	09/25/2040	2,478	357,584	0.0
Series 2014-37, Class AI(g)	5.50%	07/25/2044	4,861	829,248	0.0
Series 2015-22, Class EI(g)	6.00%	04/25/2045	21,513	3,887,801	0.0
Series 2016-11, Class GI(g)	5.00%	03/25/2046	4,444	787,702	0.0
Series 2016-26, Class IO(g)	5.00%	05/25/2046	15,324	2,566,507	0.0
Series 2016-33, Class NI(g)	5.00%	07/25/2034	17,878	3,036,757	0.0
Series 2016-34, Class AI(g)	5.00%	06/25/2046	15,765	2,541,445	0.0
Series 2016-37, Class BI(g)	5.00%	06/25/2046	28,213	4,589,030	0.1
Series 2018-54, Class IO(g)	5.50%	08/25/2048	9,046	1,715,321	0.0
Series 2020-89, Class KI(g)	4.00%	12/25/2050	83,688	12,866,101	0.1
Series 2020-96, Class KI(g)	2.50%	01/25/2051	7,603	969,546	0.0
Series 2021-18, Class IT(g)	3.00%	04/25/2051	14,907	2,027,951	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2015-62, Class GI(g)	6.50%	05/20/2045	17,551	3,503,603	0.0
Series 2019-57, Class IO(g)	5.50%	05/20/2049	5,692	1,007,866	0.0
				<u>120,475,265</u>	<u>0.6</u>
NICHT STAATLICH VARIABLE VERZINSLICH					
PMT Credit Risk Transfer Trust					
Series 2019-1R, Class A(d)	2.11%	03/27/2024	8,777	8,775,704	0.0
Series 2019-2R, Class A(d)	2.86%	05/27/2023	17,922	17,813,143	0.1
				<u>26,588,847</u>	<u>0.1</u>
				<u>1,124,046,947</u>	<u>5.7</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB FCP I - Emerging Markets Debt Portfolio - Class SA			645,951	48,808,038	0.2
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT			3,189,005	297,884,978	1.5
AB SICAV I - Global Income Portfolio			1,033,731	94,638,098	0.5
AB SICAV I - Short Duration Income Portfolio			740,668	72,785,404	0.4
AB SICAV I - Sustainable Income Portfolio			856,251	81,677,748	0.4
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT			3,919,920	56,838,845	0.3
				<u>652,633,111</u>	<u>3.3</u>
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	3.50%	09/01/2049	USD 4,754	4,941,799	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	4.00%	08/01/2049	1,059	1,114,712	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	5.00%	11/01/2049	5,273	5,801,812	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	3.50%	10/01/2049	4,481	4,672,442	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	09/01/2049	3,549	3,747,124	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	10/01/2049	7,392	7,821,251	0.0
Ginnie Mae, Series 2022	3.00%	03/01/2052	225,053	228,710,208	1.2
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2022, TBA	4.50%	03/01/2052	102,045	107,736,781	0.6
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2022, TBA	5.00%	03/01/2052	100,693	108,543,723	0.6
				<u>473,089,852</u>	<u>2.4</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E	4.65%	02/10/2036	12,568	12,309,668	0.1
Banc of America Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-UBS7, Class AS	3.99%	09/15/2048	2,340	2,414,784	0.0
Series 2016-UB10, Class C	4.85%	07/15/2049	2,354	2,437,864	0.0
Benchmark Mortgage Trust, Series 2019-B11, Class XA(g)	1.04%	05/15/2052	221,716	12,938,186	0.1
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1,					
Class XA(g)	0.99%	11/15/2050	7,875	292,104	0.0
CD Mortgage Trust, Series 2017-CD3, Class XA(g)	0.98%	02/10/2050	99,445	4,029,068	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust, Series 2016-C4, Class AM	3.69%	05/10/2058	390	398,880	0.0
CGMS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-B1, Class C	4.17%	08/15/2050	9,500	9,291,397	0.1
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2013-GC11, Class D	4.42%	04/10/2046	1,201	1,200,662	0.0
Series 2013-GC11, Class XA(g)	1.35%	04/10/2046	7,651	84,678	0.0
Series 2013-GC17, Class C	5.10%	11/10/2046	3,895	3,927,890	0.0
Series 2013-GC17, Class D	5.10%	11/10/2046	5,540	5,151,262	0.0
Series 2015-GC29, Class XA(g)	1.02%	04/10/2048	30,599	816,620	0.0
Series 2016-C3, Class XA(g)	1.03%	11/15/2049	163,111	6,561,254	0.0
Series 2016-P3, Class XA(g)	1.66%	04/15/2049	111,555	5,461,578	0.0
Series 2017-P7, Class XA(g)	1.11%	04/14/2050	81,058	3,834,723	0.0
Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	8,500	4,691,150	0.0
Series 2012-CR3, Class E	4.75%	10/15/2045	2,959	1,747,765	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2012-CR5, Class C	4.32%	12/10/2045	USD 620	\$ 610,818	0.0%
Series 2013-CR6, Class D	4.09%	03/10/2046	2,600	2,524,963	0.0
Series 2014-CR15, Class XA(g)	0.65%	02/10/2047	6,427	75,465	0.0
Series 2014-CR16, Class D	4.92%	04/10/2047	12,900	12,100,015	0.1
Series 2014-LC17, Class B	4.49%	10/10/2047	3,622	3,696,625	0.0
Series 2014-UBS6, Class AM	4.05%	12/10/2047	390	401,970	0.0
Series 2015-CR27, Class XA(g)	0.91%	10/10/2048	24,912	708,579	0.0
Series 2015-LC21, Class XA(g)	0.67%	07/10/2048	74,193	1,397,451	0.0
Series 2015-PC1, Class C	4.32%	07/10/2050	11,346	11,404,612	0.1
Series 2016-DC2, Class XA(g)	0.95%	02/10/2049	1,512	46,881	0.0
Series 2017-COR2, Class XA(g)	1.16%	09/10/2050	21,645	1,159,897	0.0
<b>Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured</b>					
<b>Pass-Through Certificates</b>					
Series K072, Class A2	3.44%	12/25/2027	12,923	13,769,957	0.1
Series K073, Class A2	3.35%	01/25/2028	11,000	11,678,012	0.1
GS Mortgage Securities Corp. II, Series 2013-GC10, Class XA(g)	1.47%	02/10/2046	29,085	275,418	0.0
<b>GS Mortgage Securities Trust</b>					
Series 2011-GC5, Class D	5.16%	08/10/2044	3,699	1,710,711	0.0
Series 2012-GCJ9, Class AS	3.12%	11/10/2045	10,000	10,057,717	0.1
Series 2013-GC13, Class D	4.06%	07/10/2046	17,538	7,333,076	0.1
Series 2014-GC22, Class C	4.69%	06/10/2047	993	1,000,152	0.0
Series 2016-GS3, Class XA(g)	1.20%	10/10/2049	114,326	5,076,383	0.0
Series 2017-GS5, Class XA(g)	0.84%	03/10/2050	135,712	5,046,087	0.0
Series 2017-GS7, Class XA(g)	1.11%	08/10/2050	83,550	3,740,216	0.0
<b>JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust</b>					
Series 2013-C15, Class AS	4.42%	11/15/2045	11,115	11,451,409	0.1
Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047	9,170	9,303,501	0.1
Series 2014-C22, Class XA(g)	0.82%	09/15/2047	56,045	924,173	0.0
Series 2014-C24, Class B	4.12%	11/15/2047	1,355	1,356,149	0.0
Series 2014-C24, Class C	4.38%	11/15/2047	455	427,449	0.0
Series 2014-C26, Class C	4.38%	01/15/2048	4,926	4,906,794	0.0
<b>JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017-C5,</b>					
Series 2017-C5, Class XA(g)	0.94%	03/15/2050	139,797	5,267,400	0.0
<b>JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b>					
Series 2012-C6, Class E	5.22%	05/15/2045	5,000	3,479,637	0.0
Series 2012-C8, Class AS	3.42%	10/15/2045	1,500	1,506,035	0.0
Series 2012-C8, Class C	4.62%	10/15/2045	9,963	9,959,815	0.1
Series 2012-LC9, Class B	3.81%	12/15/2047	2,000	2,006,506	0.0
Series 2012-LC9, Class E	4.36%	12/15/2047	10,881	9,748,530	0.1
Series 2013-C10, Class B	3.67%	12/15/2047	2,513	2,530,790	0.0
Series 2013-LC11, Class B	3.50%	04/15/2046	11,410	11,411,212	0.1
Series 2016-JP2, Class XA(g)	1.78%	08/15/2049	62,247	3,996,410	0.0
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(g)	1.51%	07/12/2050	36,726	2,287,411	0.0
<b>Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust</b>					
Series 2013-C9, Class B	3.71%	05/15/2046	6,310	6,342,009	0.0
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	4,304	4,033,059	0.0
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2011-C3, Class C	5.09%	07/15/2049	1,112	1,126,619	0.0
<b>UBS Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2012-C1, Class D	5.82%	05/10/2045	10,900	10,208,549	0.1
Series 2017-C1, Class XA(g)	1.53%	06/15/2050	47,521	3,073,145	0.0
Series 2017-C2, Class XA(g)	1.05%	08/15/2050	46,925	1,974,264	0.0
Series 2017-C4, Class XA(g)	1.01%	10/15/2050	61,618	2,877,645	0.0
Series 2017-C6, Class XA(g)	0.98%	12/15/2050	41,287	1,874,176	0.0
Series 2018-C10, Class XA(g)	0.93%	05/15/2051	130,070	6,007,817	0.0
Series 2018-C15, Class XA(g)	0.90%	12/15/2051	101,131	4,900,889	0.0
<b>UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2012-C4, Class XA(g)	1.57%	12/10/2045	3,166	15,429	0.0
Series 2013-C5, Class C	4.07%	03/10/2046	1,798	1,729,269	0.0
Series 2013-C6, Class D	4.30%	04/10/2046	8,381	7,158,963	0.1
<b>Wells Fargo Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2015-C28, Class B	4.09%	05/15/2048	2,802	2,846,534	0.0
Series 2015-LC20, Class C	4.06%	04/15/2050	7,415	7,335,926	0.1
Series 2015-LC20, Class XA(g)	1.29%	04/15/2050	32,662	965,082	0.0
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	5,156	5,310,562	0.0
Series 2016-C32, Class XA(g)	1.21%	01/15/2059	113,069	4,494,698	0.0
Series 2016-LC24, Class XA(g)	1.62%	10/15/2049	85,724	5,029,025	0.0
Series 2016-LC25, Class XA(g)	0.83%	12/15/2059	124,786	4,099,698	0.0
Series 2017-C38, Class XA(g)	1.01%	07/15/2050	36,147	1,483,449	0.0
Series 2018-C48, Class XA(g)	0.95%	01/15/2052	12,321	680,964	0.0
<b>WF-RBS Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2011-C4, Class E	4.89%	06/15/2044	8,030	6,186,523	0.0
Series 2012-C7, Class AS	4.09%	06/15/2045	265	264,518	0.0
Series 2012-C7, Class XA(g)	1.18%	06/15/2045	4,352	433	0.0
Series 2012-C8, Class XA(g)	1.69%	08/15/2045	5,669	6,368	0.0
Series 2013-C11, Class B	3.71%	03/15/2045	1,758	1,769,299	0.0
Series 2013-C14, Class B	3.84%	06/15/2046	360	360,978	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2014-C22, Class XA(g) . . . . .	0.79%	09/15/2057	USD 40,904	\$ 652,472	0.0%
Series 2014-C24, Class AS . . . . .	3.93%	11/15/2047	6,846	6,962,175	0.0
Series 2014-C25, Class D . . . . .	3.80%	11/15/2047	9,035	8,279,115	0.1
Series 2014-LC14, Class C . . . . .	4.34%	03/15/2047	853	860,049	0.0
				<u>360,877,460</u>	<u>1.8</u>
<b>NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS</b>					
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class D(d) . . . . .	4.19%	05/15/2036	9,789	8,392,302	0.1
Starwood Retail Property Trust, Series 2014-STAR, Class A(d) . . . . .	1.66%	11/15/2027	36,183	23,699,955	0.1
				<u>32,092,257</u>	<u>0.2</u>
				<u>392,969,717</u>	<u>2.0</u>
<b>QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE</b>					
<b>QUASI-STAATSANLEIHEN</b>					
<b>BAHRAIN</b>					
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The) . . . . .	7.50%	10/25/2027	25,539	26,496,712	0.1
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The) . . . . .	7.63%	11/07/2024	2,487	2,598,915	0.0
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The) . . . . .	8.38%	11/07/2028	4,380	4,740,036	0.0
				<u>33,835,663</u>	<u>0.1</u>
<b>CHILE</b>					
Corp. Nacional del Cobre de Chile . . . . .	3.75%	01/15/2031	5,181	5,219,858	0.0
<b>INDONESIEN</b>					
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT . . . . .	4.75%	05/15/2025	5,426	5,535,117	0.0
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT . . . . .	5.45%	05/15/2030	4,342	4,581,624	0.0
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT . . . . .	5.71%	11/15/2023	1,065	1,109,464	0.0
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara . . . . .	3.88%	07/17/2029	17,819	17,638,582	0.1
				<u>28,864,787</u>	<u>0.1</u>
<b>KASACHSTAN</b>					
KazMunayGas National Co. JSC . . . . .	4.75%	04/24/2025	1,395	1,438,419	0.0
<b>MEXIKO</b>					
Comision Federal de Electricidad . . . . .	4.69%	05/15/2029	20,918	20,944,147	0.1
Petroleos Mexicanos . . . . .	5.95%	01/28/2031	71,699	66,676,485	0.3
Petroleos Mexicanos . . . . .	6.49%	01/23/2027	10,352	10,626,328	0.1
Petroleos Mexicanos . . . . .	6.75%	09/21/2047	48,445	39,889,613	0.2
Petroleos Mexicanos . . . . .	6.95%	01/28/2060	18,641	15,390,010	0.1
				<u>153,526,583</u>	<u>0.8</u>
<b>OMAN</b>					
Lamar Funding Ltd. . . . .	3.96%	05/07/2025	2,359	2,313,000	0.0
<b>PANAMA</b>					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA . . . . .	4.00%	08/11/2041	9,964	9,118,928	0.1
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA . . . . .	5.13%	08/11/2061	8,472	7,679,339	0.0
				<u>16,798,267</u>	<u>0.1</u>
<b>SÜDAFRIKA</b>					
Eskom Holdings SOC Ltd. . . . .	6.35%	08/10/2028	11,899	12,092,359	0.1
Transnet SOC Ltd. . . . .	4.00%	07/26/2022	1,437	1,422,630	0.0
				<u>13,514,989</u>	<u>0.1</u>
<b>TRINIDAD &amp; TOBAGO</b>					
Trinidad Generation UnLtd . . . . .	5.25%	11/04/2027	11,768	11,826,840	0.1
Trinidad Generation UnLtd. . . . .	5.25%	11/04/2027	5,000	5,025,000	0.0
				<u>16,851,840</u>	<u>0.1</u>
<b>UKRAINE</b>					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC . . . . .	7.63%	11/08/2026	14,994	3,748,500	0.0
State Agency of Roads of Ukraine . . . . .	6.25%	06/24/2028	22,184	6,655,200	0.1
				<u>10,403,700</u>	<u>0.1</u>
				<u>282,767,106</u>	<u>1.4</u>
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>CLO – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
AGL CLO Ltd., Series 2021-16A, Class D(d) . . . . .	3.35%	01/20/2035	5,550	5,443,412	0.0
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class D(d) . . . . .	3.95%	01/20/2034	4,250	4,177,563	0.0
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class D(d) . . . . .	3.14%	04/15/2034	6,750	6,566,866	0.0
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class D(d) . . . . .	3.39%	04/15/2034	4,750	4,651,775	0.0
AIG CLO Ltd., Series 2021-3A, Class D(d) . . . . .	3.21%	01/25/2035	10,400	10,193,113	0.1
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class D(d) . . . . .	2.90%	04/20/2034	6,000	5,892,918	0.0
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class D(d) . . . . .	3.23%	10/20/2034	4,000	3,891,968	0.0
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class C(d) . . . . .	3.85%	01/20/2034	8,330	8,185,416	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(d) . . . . .	2.02%	04/26/2031	11,000	10,804,882	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class B(d) . . . . .	3.31%	07/23/2032	8,000	7,707,952	0.1
CBAM Ltd., Series 2018-7A, Class B1(d) . . . . .	1.85%	07/20/2031	7,726	7,657,787	0.1
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(d) . . . . .	6.54%	07/18/2030	4,717	4,592,705	0.0
Dryden CLO Ltd., Series 2018-57A, Class A(d) . . . . .	1.52%	05/15/2031	25,195	25,011,857	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Goldentree Loan Opportunities Ltd., Series 2015-11A, Class AR2(d) . . . . .	1.31%	01/18/2031	USD 600	\$ 597,034	0.0%
Greywolf CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A1(d) . . . . .	1.30%	04/26/2031	22,100	21,961,499	0.1
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd., Series 2018-1A, Class A2(d) . . . . .	2.05%	07/21/2031	7,424	7,341,206	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(d) . . . . .	3.00%	10/20/2030	6,000	5,841,066	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-43A, Class D(d) . . . . .	3.34%	07/17/2035	11,050	10,959,733	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class DR(d) . . . . .	3.14%	10/16/2033	1,875	1,848,109	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class D(d) . . . . .	3.85%	01/20/2032	1,000	983,189	0.0
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class D(d) . . . . .	3.48%	10/20/2034	11,950	11,641,523	0.1
Octagon Investment Partners 35 Ltd., Series 2018-1A, Class D(d)	5.45%	01/20/2031	2,750	2,512,972	0.0
OZLM Ltd., Series 2018-18A, Class B(d) . . . . .	1.79%	04/15/2031	3,000	2,962,854	0.0
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class D(d) . . . . .	3.35%	07/20/2034	4,000	3,903,264	0.0
Sound Point CLO XIX Ltd., Series 2018-1A, Class A(d) . . . . .	1.24%	04/15/2031	34,104	33,898,148	0.2
Venture XXVII CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(d) . . . . .	4.25%	07/20/2030	17,169	17,173,539	0.1
Wehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class D(d) . . . . .	0.00%	04/21/2035	7,000	7,000,000	0.0
				233,402,350	1.2
<b>SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Melco Resorts Finance Ltd. . . . .	5.38%	12/04/2029	12,622	10,912,981	0.1
Melco Resorts Finance Ltd. . . . .	5.63%	07/17/2027	9,002	8,375,686	0.0
MGM China Holdings Ltd. . . . .	5.25%	06/18/2025	8,970	8,506,363	0.1
MGM China Holdings Ltd. . . . .	5.38%	05/15/2024	4,527	4,380,721	0.0
MGM China Holdings Ltd. . . . .	5.88%	05/15/2026	4,869	4,650,808	0.0
Studio City Finance Ltd. . . . .	5.00%	01/15/2029	30,884	23,882,983	0.1
Wynn Macau Ltd. . . . .	4.88%	10/01/2024	953	880,513	0.0
Wynn Macau Ltd. . . . .	5.50%	01/15/2026	30,257	27,394,688	0.1
Wynn Macau Ltd. . . . .	5.50%	10/01/2027	4,203	3,653,668	0.0
Wynn Macau Ltd. . . . .	5.63%	08/26/2028	16,758	14,450,423	0.1
				107,088,834	0.5
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV . . . . .	4.75%	05/09/2027	25,018	23,829,645	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV . . . . .	5.13%	05/09/2029	19,409	18,486,830	0.1
				42,316,475	0.2
<b>ENERGIE</b>					
Leviathan Bond Ltd. . . . .	5.75%	06/30/2023	16,779	16,837,726	0.1
Leviathan Bond Ltd. . . . .	6.13%	06/30/2025	5,318	5,390,114	0.0
Leviathan Bond Ltd. . . . .	6.50%	06/30/2027	12,964	13,200,044	0.1
				35,427,884	0.2
				184,833,193	0.9
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd./ Highlands Holdings Bond Co-Issuer, Inc.(b) . . . . .	7.63%	10/15/2025	12,319	12,688,218	0.1
				197,521,411	1.0
<b>REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN</b>					
<b>KATAR</b>					
Qatar Government International Bond . . . . .	3.75%	04/16/2030	16,175	17,428,563	0.1
<b>SAUDI-ARABIEN</b>					
Saudi Government International Bond . . . . .	2.90%	10/22/2025	16,949	17,351,539	0.1
Saudi Government International Bond . . . . .	3.25%	10/26/2026	21,000	21,761,250	0.1
Saudi Government International Bond . . . . .	3.25%	10/22/2030	17,883	18,441,843	0.1
				57,554,632	0.3
				74,983,195	0.4
<b>ABS-ANLEIHEN</b>					
<b>AUTOS – FESTVERZINSLICH</b>					
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2019-2A, Class C . . . . .	4.24%	09/22/2025	4,000	4,113,818	0.0
Exeter Automobile Receivables Trust, Series 2018-4A, Class E . . . . .	5.38%	07/15/2025	13,125	13,543,957	0.1
First Investors Auto Owner Trust, Series 2018-1A, Class E . . . . .	5.35%	07/15/2024	3,100	3,157,815	0.0
Flagship Credit Auto Trust Series 2019-1, Class E . . . . .	5.06%	06/15/2026	5,339	5,474,753	0.0
Series 2019-2, Class E . . . . .	4.52%	12/15/2026	5,677	5,782,927	0.1
Series 2019-3, Class E . . . . .	3.84%	12/15/2026	5,230	5,246,246	0.0
				37,319,516	0.2

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS</b>					
Consumer Loan Underlying Bond CLUB Credit Trust, Series 2019-P2, Class B	2.83%	10/15/2026	USD 5 \$	5,396	0.0%
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust Series 2018-P1, Class C	5.21%	07/15/2025	3,417	3,439,892	0.0
Series 2018-P2, Class C	5.21%	10/15/2025	2,060	2,074,400	0.0
Marlette Funding Trust Series 2017-3A, Class D	5.03%	12/15/2024	391	392,361	0.0
Series 2018-1A, Class D	4.85%	03/15/2028	3,820	3,823,010	0.0
Series 2018-2A, Class C	4.37%	07/17/2028	692	692,585	0.0
Series 2018-3A, Class C	4.63%	09/15/2028	7,538	7,535,528	0.1
Series 2018-4A, Class C	4.91%	12/15/2028	6,286	6,296,473	0.1
SoFi Consumer Loan Program Trust, Series 2018-2, Class C	4.25%	04/26/2027	5,522	5,537,416	0.0
				<u>29,797,061</u>	<u>0.2</u>
				<u>67,116,577</u>	<u>0.4</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE</b>					
<b>OMAN</b>					
Oman Government International Bond	4.75%	06/15/2026	27,213	27,144,967	0.2
Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025	5,346	5,412,825	0.0
				<u>32,557,792</u>	<u>0.2</u>
<b>BAHRAIN</b>					
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	16,444	15,128,480	0.1
Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030	7,799	8,261,091	0.0
				<u>23,389,571</u>	<u>0.1</u>
				<u>55,947,363</u>	<u>0.3</u>
<b>VORZUGSAKTIEN</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Hartford Financial Services Group, Inc. (The)	7.88%		80,075	2,028,300	0.0
				<u>19,683,142,075</u>	<u>100.0</u>
<b>GELDMARKTINSTRUMENTE</b>					
<b>SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG</b>					
<b>CHINA</b>					
Yango Justice International Ltd.	10.25%	09/15/2022	USD 335	43,550	0.0
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>ABS-ANLEIHEN</b>					
<b>AUTOS – FESTVERZINSLICH</b>					
Exeter Automobile Receivables Trust, Series 2017-3A, Class D	5.28%	10/15/2024	11,280	11,408,390	0.1
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>CLO – VARIABLE VERZINSLICH</b>					
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class D(d)	3.10%	07/20/2034	6,000	5,867,658	0.0
AGL CLO 13 Ltd., Series 2021-13A, Class D(d)	3.31%	10/20/2034	27,834	27,185,307	0.1
Apidos CLO XXIII, Series 2015-23A, Class ER(d)	6.44%	04/15/2033	2,248	2,173,107	0.0
Ballyrock CLO 16 Ltd., Series 2021-16A, Class C(d)	3.15%	07/20/2034	3,000	2,921,919	0.0
Ballyrock CLO 17 Ltd., Series 2021-17A, Class C(d)	3.19%	10/20/2034	13,950	13,575,289	0.1
CIFC Funding Ltd., Series 2017-3A, Class A1(d)	1.47%	07/20/2030	560	559,424	0.0
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-1RA, Class D(d)	3.29%	07/15/2030	1,500	1,466,019	0.0
ICG US CLO Ltd., Series 2015-1A, Class CR(d)	3.35%	10/19/2028	2,500	2,473,402	0.0
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class D(d)	3.29%	04/15/2034	8,000	7,860,808	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class CR(d)	2.14%	10/16/2033	12,000	11,905,296	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class D(d)	3.04%	07/16/2035	4,000	3,878,116	0.0
Northwoods Capital Ltd., Series 2018-12BA, Class B(d)	2.05%	06/15/2031	5,400	5,320,550	0.0
Octagon Investment Partners 38 Ltd., Series 2018-1A, Class B(d)	2.20%	07/20/2030	3,900	3,825,607	0.0
OZLM Ltd., Series 2014-7RA, Class BR(d)	2.44%	07/17/2029	9,000	8,941,545	0.1
OZLM Ltd., Series 2014-7RA, Class CR(d)	3.24%	07/17/2029	10,500	10,219,345	0.1
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class A(d)	1.26%	04/15/2031	9,625	9,562,447	0.1
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class D(d)	3.20%	10/20/2034	27,675	27,109,019	0.1
PPM CLO 5 Ltd., Series 2021-5A, Class D(d)	3.17%	10/18/2034	16,000	15,567,152	0.1
THL Credit Wind River CLO Ltd., Series 2017-4A, Class A(d)	1.63%	11/20/2030	6,898	6,888,466	0.0
TICP CLO IX Ltd., Series 2017-9A, Class B(d)	1.85%	01/20/2031	1,550	1,536,823	0.0
Venture XXIX CLO Ltd., Series 2017-29A, Class C(d)	3.01%	09/07/2030	2,300	2,262,197	0.0
Voya CLO Ltd., Series 2016-3A, Class A1R(d)	1.43%	10/18/2031	3,000	2,981,631	0.0
Voya CLO Ltd., Series 2016-3A, Class BR(d)	2.44%	10/18/2031	10,000	9,773,340	0.1
				<u>183,854,468</u>	<u>0.9</u>



	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
JPMorgan Madison Avenue Securities Trust, Series 2015-CH1, Class M2(d) . . . . .	5.69%	10/25/2025	USD 513	\$ 517,391	0.0%
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2020-1R, Class A(d) . . . . .	2.46%	02/27/2023	16,263	16,259,195	0.1
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust, Series 2015-WF1, Class 1M2(d) . . . . .	5.44%	11/25/2025	602	<u>573,995</u>	<u>0.0</u>
				<u>17,350,581</u>	<u>0.1</u>
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>					
<b>NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS</b>					
Commercial Mortgage Trust, Series 2012-CR3, Class D . . . . .	4.75%	10/15/2045	3,971	3,149,275	0.0
Grantor Trust CGCMT, Series 2015-GC17(h) . . . . .	4.49%	09/15/2048	105	4,870,136	0.0
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(h) . . . . .	0.00%	10/03/2047	143	5,374,521	0.0
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(h) . . . . .	4.00%	04/15/2050	207	5,612,197	0.0
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(h) . . . . .	4.00%	11/15/2047	222	2,443,035	0.0
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(h) . . . . .	3.40%	10/15/2057	125	3,498,531	0.0
GS Mortgage Securities Trust Series 2013-GC13, Class E(h) . . . . .	7.49%	10/07/2046	231	7,872,403	0.1
Series 2013-GC13, Class F(h) . . . . .	7.49%	10/07/2046	80	2,781,700	0.0
WFRBS Commercial Mortgage Trust Series 2012-C7, Class E . . . . .	4.73%	06/15/2045	8,500	1,253,750	0.0
Series 2012-C9, Class E . . . . .	4.81%	11/15/2045	5,000	<u>4,678,703</u>	<u>0.1</u>
				<u>41,534,251</u>	<u>0.2</u>
<b>STAMMAKTIEN</b>					
Mt Logan Re Ltd. Special Invest(h) . . . . .			10,878	<u>10,873,381</u>	<u>0.1</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
ABN AMRO Bank NV . . . . .	7.75%	05/15/2023	USD 7,651	<u>8,064,826</u>	<u>0.0</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG</b>					
Royal Caribbean Cruises Ltd. . . . .	5.50%	08/31/2026	23,060	22,907,343	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd. . . . .	11.50%	06/01/2025	34,310	<u>37,773,594</u>	<u>0.2</u>
				<u>60,680,937</u>	<u>0.3</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
OEC Finance Ltd.(b) . . . . .	4.38%	10/25/2029	4,863	<u>194,533</u>	<u>0.0</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
Odebrecht Holdco Finance Ltd. . . . .	0.00%	09/10/2058	19,218	76,871	0.0
Sable International Finance Ltd. . . . .	5.75%	09/07/2027	30,147	30,831,478	0.2
Tonon Luxembourg SA(b)(e)(h) . . . . .	6.50%	10/31/2024	4,600	0	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(h)(i) . . . . .	10.50%	01/28/2018	3,700	370	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(h)(i) . . . . .	11.75%	02/09/2022	31,238	<u>3,124</u>	<u>0.0</u>
				<u>30,911,843</u>	<u>0.2</u>
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
Terraform Global Operating LLC . . . . .	6.13%	03/01/2026	7,314	<u>7,340,083</u>	<u>0.0</u>
				<u>38,446,459</u>	<u>0.2</u>
<b>GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
State of California, Series 2010 . . . . .	7.60%	11/01/2040	1,600	2,560,601	0.0
State of Illinois, Series 2010 . . . . .	7.35%	07/01/2035	7,675	9,277,582	0.0
Wisconsin Public Finance Authority, Series 2021 . . . . .	5.75%	07/25/2041	15,000	<u>15,749,346</u>	<u>0.1</u>
				<u>27,587,529</u>	<u>0.1</u>
				<u>399,800,822</u>	<u>2.0</u>
<b>Gesamtanlagen</b>					
(Kosten \$21,561,707,804) . . . . .				<u>\$ 20,082,986,447</u>	<u>102.0%</u>
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(j) . . . . .	(0.21)%	–		25,943	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(j) . . . . .	0.01 %	–		5,588	0.0
BBH, Grand Cayman(j) . . . . .	0.25 %	–		4,950	0.0
BBH, Grand Cayman(j) . . . . .	3.00 %	–		196,309	0.0
BNP Paribas, Paris(j) . . . . .	(0.31)%	–		71	0.0
BNP Paribas, Paris(j) . . . . .	0.08 %	–		954	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(j) . . . . .	(0.78)%	–		1,218,520	0.0

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettovermögen %
SEB, Stockholm(j) .....	0.01 %	–	\$ 244,923,056	1.3%
Sumitomo, London(j) .....	0.10 %	–	39,138	0.0
<b>Termineinlagen insgesamt</b> .....			<u>246,414,529</u>	<u>1.3</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> .....			<u>(645,285,125)</u>	<u>(3.3)</u>
<b>Nettovermögen</b> .....			<u>\$ 19,684,115,851</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
<b>Long</b>					
U.S. Long Bond (CBT) Futures .....	06/21/2022	2,411	\$ 376,367,406	\$ 377,773,562	\$ 1,406,156
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures .....	06/30/2022	2,585	304,019,766	305,757,031	1,737,265
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures .....	06/21/2022	9,402	1,188,308,836	1,198,167,375	9,858,539
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures .....	06/21/2022	2,699	494,490,164	501,845,313	7,355,149
<b>Short</b>					
U.S. 10 Yr Ultra Futures .....	06/21/2022	3,936	549,588,641	556,267,500	(6,678,859)
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures .....	06/30/2022	1,235	265,128,914	265,804,804	(675,890)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures .....	06/21/2022	71	8,973,734	9,048,062	(74,328)
					<u>\$ 12,928,032</u>
				Wertsteigerung	\$ 20,357,109
				Wertminderung	\$ (7,429,077)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	AUD 32,659	USD 23,357	03/04/2022	\$ (363,882)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	CAD 1,151	USD 908	03/04/2022	357
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	CAD 6,735	USD 5,294	03/04/2022	(19,258)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	CNH 35,886	USD 5,647	03/04/2022	(39,820)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	GBP 6,764	USD 9,170	03/04/2022	95,654
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	GBP 44	USD 59	03/04/2022	(25)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 596,150	AUD 835,730	03/04/2022	10,850,183
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 108,599	CAD 137,812	03/04/2022	128,935
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 64,262	CNH 407,474	03/04/2022	306,927
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 320	GBP 238	03/04/2022	163
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 186,078	GBP 136,916	03/04/2022	(2,403,060)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	CAD 5,014	USD 3,940	03/14/2022	(15,683)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	CNH 24,019	USD 3,784	03/14/2022	(19,907)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 6,010	USD 6,827	03/14/2022	84,678
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 485	USD 543	03/14/2022	(655)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	GBP 4,835	USD 6,558	03/14/2022	71,147
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	GBP 44	USD 59	03/14/2022	(30)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	PLN 10,309	USD 2,554	03/14/2022	100,270
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	SGD 8,210	USD 6,097	03/14/2022	41,686
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 105,246	CAD 133,816	03/14/2022	333,650
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 62,736	CNH 399,863	03/14/2022	582,794
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 257	EUR 230	03/14/2022	294
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 100,690	EUR 88,400	03/14/2022	(1,521,133)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 320	GBP 238	03/14/2022	193
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 183,970	GBP 136,003	03/14/2022	(1,502,083)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 25,606	PLN 101,427	03/14/2022	(1,467,140)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 176,789	SGD 237,699	03/14/2022	(1,470,981)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 45,206	ZAR 688,072	03/14/2022	(526,749)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	ZAR 19,397	USD 1,275	03/14/2022	15,539
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	AUD 22,587	USD 16,176	03/15/2022	(232,119)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 497,438	AUD 694,536	03/15/2022	7,096,038
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	CAD 1,027	USD 805	03/18/2022	(5,444)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	CHF 281	USD 303	03/18/2022	(3,276)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 2,207	USD 2,493	03/18/2022	16,953
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 485	USD 543	03/18/2022	(698)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	JPY 16,697	USD 145	03/18/2022	(718)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	NZD 225	USD 152	03/18/2022	69
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	NZD 2,227	USD 1,494	03/18/2022	(12,158)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	SGD 3,589	USD 2,663	03/18/2022	16,245
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 65,983	CAD 83,748	03/18/2022	95,045
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 18,980	CNH 17,513	03/18/2022	130,666
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	USD 257	EUR 230	03/18/2022	314

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	92,524	EUR	81,398	03/18/2022	\$ (1,192,892)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	21,515	JPY	2,483,682	03/18/2022	97,027
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	115,172	NZD	173,031	03/18/2022	1,876,404
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	147,860	SGD	198,702	03/18/2022	(1,306,685)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	77,838	ZAR	1,179,116	03/18/2022	(1,317,817)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	3,215	USD	211	03/18/2022	2,389
						<u>\$ 8,521,407</u>
					Wertsteigerung	\$ 21,943,620
					Wertminderung	\$ (13,422,213)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

#### VERKAUFTE ZINS-SWAPTIONS

Bezeichnung	Ausübungs- preis	Fälligkeit	Nominalbetrag (000)	Prämien erhalten	Marktwert
Put - OTC - 1 Year Interest Rate Swap .....	1.85%	03/10/2022	USD 262,640	\$ 2,214,055	<u>\$ (240,442)</u>

#### ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Verkaufskontrakte</b>					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 5,000	\$ (404,500)	\$ (330,573)
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 34, 5 Year Index	05/11/2063	114,655	6,319,818	1,942,417
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 37, 5 Year Index	05/11/2063	1,202,191	67,122,820	(38,357,931)
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Russian Federation	05/11/2063	24,264	(11,395,668)	(11,590,280)
Goldman Sachs International/(INTRCONX)	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(404,500)	(330,573)
Insgesamt				<u>\$ 61,237,970</u>	<u>\$ (48,666,940)</u>
				Wertsteigerung	\$ 1,942,417
				Wertminderung	\$ (50,609,357)

#### ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	USD 453,010	04/20/2023	2.850%	3 Month LIBOR	\$ (8,253,692)
UBS	58,460	06/28/2026	1.460%	3 Month LIBOR	<u>848,632</u>
Insgesamt					<u>\$ (7,405,060)</u>
				Wertsteigerung	\$ 848,632
				Wertminderung	\$ (8,253,692)

#### CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Verkaufskontrakte</b>						
Barclays Bank PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 4,800	\$ (2,026,560)	\$ (91,774)	\$ (1,934,786)
Barclays Bank PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	24,895	(6,044,478)	(377,163)	(5,667,315)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	500	(40,450)	285	(40,735)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,000	(809,000)	(187,309)	(621,691)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,000	(809,000)	(173,067)	(635,933)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	20,000	(1,618,000)	(386,556)	(1,231,444)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	06/20/2023	4,800	(2,026,560)	(91,829)	(1,934,731)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,561	(659,037)	(286,329)	(372,708)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,123	(1,318,480)	(577,386)	(741,094)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,123	(1,318,480)	(574,670)	(743,810)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,123	(1,318,480)	(562,913)	(755,567)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(786,968)	(1,239,592)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(764,286)	(1,262,274)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(692,773)	(1,333,787)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,480	(1,891,591)	(522,501)	(1,369,090)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,680	(3,242,496)	(1,434,572)	(1,807,924)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(100,822)	(1,925,738)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 4,800	\$ (2,026,560)	\$ (100,822)	\$ (1,925,738)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(94,044)	(1,932,516)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	12/20/2026	310	(75,193)	(18,663)	(56,530)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	12/20/2026	1,925	(467,359)	(117,805)	(349,554)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	12/20/2026	9,648	(2,342,598)	(581,440)	(1,761,158)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	12/20/2026	9,958	(2,417,791)	(609,442)	(1,808,349)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	12/20/2026	17,991	(4,368,223)	(1,101,079)	(3,267,144)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(2,976,553)	558,762
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(2,952,929)	535,138
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(1,572,120)	363,224
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(1,464,464)	255,568
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,651	(1,614,843)	(1,717,448)	102,605
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	256	(62,137)	(30,668)	(31,469)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	364	(88,491)	(43,511)	(44,980)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	12,471	(3,028,041)	(2,981,131)	(46,910)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	12,471	(3,028,041)	(2,951,320)	(76,721)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	836	(203,094)	(107,823)	(95,271)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	16,628	(4,037,227)	(3,934,936)	(102,291)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,992	(483,558)	(195,619)	(287,939)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(422,385)	(786,511)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(297,371)	(911,525)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,975	(1,450,675)	(479,583)	(971,092)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,627	(2,094,532)	(742,066)	(1,352,466)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(990,228)	(1,427,563)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(987,725)	(1,430,066)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(975,814)	(1,441,977)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(969,232)	(1,448,559)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(921,309)	(1,496,482)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	14,937	(3,626,687)	(2,077,715)	(1,548,972)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(834,855)	(1,582,936)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(586,245)	(1,831,546)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	14,937	(3,626,687)	(1,345,593)	(2,281,094)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	14,937	(3,626,687)	(1,192,735)	(2,433,952)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	19,916	(4,835,582)	(1,813,073)	(3,022,509)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	19,916	(4,835,582)	(1,801,127)	(3,034,455)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	19,256	(4,675,282)	(1,629,924)	(3,045,358)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	24,895	(6,044,478)	(2,276,378)	(3,768,100)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	24,895	(6,044,478)	(2,110,469)	(3,934,009)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	24,895	(6,044,478)	(1,624,142)	(4,420,336)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	29,874	(7,253,373)	(2,411,713)	(4,841,660)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	24,895	(6,044,478)	(460,366)	(5,584,112)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	34,554	(8,389,735)	(2,072,361)	(6,317,374)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	49,790	(12,088,955)	(4,552,765)	(7,536,190)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	49,790	(12,088,955)	(3,230,919)	(8,858,036)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	2,477	(200,389)	(93,906)	(106,483)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,640	(294,476)	(142,745)	(151,731)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	4,465	(361,219)	(166,756)	(194,463)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	4,853	(392,608)	(187,646)	(204,962)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	4,955	(400,860)	(191,413)	(209,447)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	12,387	(1,002,108)	(469,607)	(532,501)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,100	(817,090)	(101,389)	(715,701)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,320	(1,823,904)	(389,448)	(1,434,456)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(87,293)	(1,939,267)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,120	(3,850,464)	(852,959)	(2,997,505)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,600	(4,053,120)	(188,087)	(3,865,033)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,330	(565,763)	(29,084)	(536,679)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	2,500	(202,250)	1,423	(203,673)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(404,500)	(186,151)	(218,349)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(404,500)	(96,639)	(307,861)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,138	(1,324,965)	(586,685)	(738,280)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	40,800	(17,225,760)	(7,501,426)	(9,724,334)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	12/20/2026	9,958	(2,417,791)	(749,057)	(1,668,734)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	12/20/2026	19,344	(4,696,801)	(1,362,951)	(3,333,850)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	12/20/2026	19,916	(4,835,582)	(1,237,312)	(3,598,270)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	317	(76,886)	(31,929)	(44,957)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(682,785)	(526,111)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(658,540)	(550,356)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,065	(986,942)	(409,854)	(577,088)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,142	(1,005,559)	(282,154)	(723,405)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,272	(1,037,232)	(295,716)	(741,516)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(1,347,403)	(1,070,388)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	11,252	(2,732,104)	(1,175,927)	(1,556,177)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	11,107	(2,696,804)	(776,019)	(1,920,785)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 19,916	\$ (4,835,582)	\$ (2,634,161)	\$ (2,201,421)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	83,115	(20,180,334)	(9,663,042)	(10,517,292)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	233,671	(56,735,400)	(24,942,678)	(31,792,722)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	7,042	(569,698)	(269,703)	(299,995)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(404,500)	(103,740)	(300,760)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(404,500)	(51,790)	(352,710)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(404,500)	(45,745)	(358,755)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,000	(809,000)	(403,996)	(405,004)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,000	(809,000)	(365,248)	(443,752)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	8,283	(670,095)	(170,552)	(499,543)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	25,000	(2,022,500)	(866,558)	(1,155,942)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	359	(151,587)	(67,066)	(84,521)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,932	(815,488)	(358,522)	(456,966)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,116	(1,315,643)	(573,430)	(742,213)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,116	(1,315,643)	(571,147)	(744,496)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(701,335)	(1,325,225)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(697,078)	(1,329,482)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,720	(2,837,184)	(857,463)	(1,979,721)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,600	(4,053,120)	(1,676,286)	(2,376,834)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	11,971	(5,054,241)	(2,175,865)	(2,878,376)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	12,460	(5,260,544)	(2,249,740)	(3,010,804)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(739,688)	(469,208)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,485	(846,227)	(369,403)	(476,824)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(649,018)	(559,878)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(551,749)	(657,147)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(528,991)	(679,905)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,991	(1,211,845)	(530,919)	(680,926)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(489,048)	(719,848)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,425	(1,559,959)	(828,182)	(731,777)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(462,447)	(746,449)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(425,759)	(783,137)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,943	(1,685,684)	(863,659)	(822,025)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,461	(1,568,614)	(688,048)	(880,566)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(1,501,513)	(916,278)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(1,479,377)	(938,414)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(1,475,948)	(941,843)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(1,467,195)	(950,596)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(1,193,634)	(1,224,157)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(1,003,606)	(1,414,185)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	12,816	(3,111,697)	(869,533)	(2,242,164)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	14,937	(3,626,687)	(893,841)	(2,732,846)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	24,895	(6,044,478)	(3,273,846)	(2,770,632)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	24,895	(6,044,478)	(2,245,424)	(3,799,054)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	29,874	(7,253,373)	(2,533,144)	(4,720,229)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	49,790	(12,088,955)	(4,425,458)	(7,663,497)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	49,790	(12,088,955)	(4,084,218)	(8,004,737)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	325	(26,320)	(12,780)	(13,540)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,000	(809,000)	(187,309)	(621,691)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,240	(945,593)	(262,853)	(682,740)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(89,397)	(1,937,163)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(85,041)	(1,941,519)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,800	(2,026,560)	(80,204)	(1,946,356)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,600	(4,053,120)	(183,370)	(3,869,750)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,600	(4,053,120)	(178,981)	(3,874,139)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,979	(1,208,896)	(682,785)	(526,111)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,668	(1,861,699)	(979,186)	(882,513)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,502	(1,578,576)	(435,371)	(1,143,205)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(150,366)	(2,267,425)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,958	(2,417,791)	(104,685)	(2,313,106)
Insgesamt				<u>\$(455,789,970)</u>	<u>\$(174,699,122)</u>	<u>\$(281,090,848)</u>
					Wertsteigerung	\$ 1,815,297
					Wertminderung	\$ (282,906,145)

**INFLATIONS-SWAPS (VPI)**

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Deutsche Bank AG	USD 65,000	01/15/2026	1.578%	CPI#	\$ 10,696,639
Swaps insgesamt					<u>\$ (326,466,209)</u>

- 
- # Variabler Zinssatz auf Basis der gemäß Verbraucherpreisindex ermittelten Inflationsrate.
- (a) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für offene OTC-Derivate zu dienen.
- (b) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (c) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (d) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2022.
- (e) Not leidend.
- (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) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (i) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (j) Tagesgeld.

**Währungskürzel:**

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

**Glossar:**

- ABS – Asset-Backed Securities  
CBT – Chicago Board of Trade  
CDX-CMBX.NA – North American Commercial Mortgage-Backed Index  
CDX-NAHY – North American High Yield Credit Default Swap Index  
CLO – Collateralized Loan Obligations  
CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities  
CME – Chicago Mercantile Exchange  
CPI – Consumer Price Index  
INTRCONX – Inter-Continental Exchange  
JSC – Joint Stock Company  
LIBOR – London Interbank Offered Rate  
REIT – Real Estate Investment Trust  
REMICs – Real Estate Mortgage Investment Conduits  
TBA – To Be Announced

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>					
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy	3.63%	02/04/2028	EUR 5,149	€ 4,856,915	0.3%
Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV	3.75%	01/15/2025	1,939	1,901,224	0.1
Chemours Co. (The)	4.00%	05/15/2026	5,875	5,698,750	0.3
Guala Closures SpA	3.25%	06/15/2028	2,260	2,032,581	0.1
INEOS Quattro Finance 1 PLC	3.75%	07/15/2026	5,128	4,822,612	0.3
Kronos International, Inc.	3.75%	09/15/2025	7,448	7,326,399	0.4
OCI NV	3.63%	10/15/2025	3,196	3,221,109	0.2
Olympus Water US Holding Corp.	3.88%	10/01/2028	2,986	2,788,128	0.1
Olympus Water US Holding Corp.	5.38%	10/01/2029	4,440	3,995,912	0.2
Rimini Bidco SpA(a)	5.25%	12/14/2026	8,960	8,436,057	0.4
Schoeller Packaging BV	6.38%	11/01/2024	7,446	7,270,487	0.4
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	4.38%	11/01/2026	2,200	2,143,208	0.1
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC(a)	4.38%	11/01/2026	2,582	2,564,153	0.1
SGL Carbon SE	4.63%	09/30/2024	5,115	4,995,674	0.3
Solvay Finance SAC(A)(b)	5.87%	06/03/2024	8,000	8,449,606	0.5
				<u>70,502,815</u>	<u>3.8</u>
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
ARD Finance SA(c)	5.00%	06/30/2027	8,223	7,843,557	0.4
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance PLC	3.00%	09/01/2029	6,591	5,898,945	0.3
Ctec II GmbH	5.25%	02/15/2030	10,308	9,650,186	0.5
IMA Industria Macchine Automatiche SpA	3.75%	01/15/2028	2,100	1,966,953	0.1
Paprec Holding SA	4.00%	03/31/2025	10,544	10,506,302	0.6
PCF GmbH	4.75%	04/15/2026	7,640	7,368,833	0.4
Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025	11,278	11,336,075	0.6
Rolls-Royce PLC	4.63%	02/16/2026	2,880	2,987,578	0.2
TK Elevator Holdco GmbH	6.63%	07/15/2028	2,836	2,833,925	0.1
TK Elevator Midco GmbH	4.38%	07/15/2027	1,868	1,862,413	0.1
Trivium Packaging Finance BV	3.75%	08/15/2026	11,064	10,581,958	0.6
				<u>72,836,725</u>	<u>3.9</u>
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Altice Finco SA	4.75%	01/15/2028	6,500	5,742,751	0.3
Banjay Entertainment SASU	3.50%	03/01/2025	5,108	4,975,491	0.3
Banjay Group SAS	6.50%	03/01/2026	776	766,582	0.0
Summer BC Holdco A SARL	9.25%	10/31/2027	4,776	4,951,227	0.3
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	7,385	7,436,080	0.4
UPCB Finance VII Ltd.	3.63%	06/15/2029	2,877	2,777,156	0.1
Virgin Media Secured Finance PLC	5.00%	04/15/2027	GBP 8,830	10,640,238	0.6
Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC	4.88%	07/15/2028	7,199	8,081,132	0.4
Ziggo Bond Co. BV	3.38%	02/28/2030	EUR 5,350	4,767,544	0.3
				<u>50,138,201</u>	<u>2.7</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
Altice France SA/France	5.88%	02/01/2027	4,635	4,751,094	0.3
Arqiva Broadcast Finance PLC	6.75%	09/30/2023	GBP 5,834	6,996,994	0.4
Iliad Holading SASU	5.13%	10/15/2026	EUR 3,650	3,636,974	0.2
Kaixo Bondco Telecom SA	5.13%	09/30/2029	3,462	3,220,633	0.2
Lorca Telecom Bondco SA	4.00%	09/18/2027	7,898	7,558,483	0.4
Telecom Italia SpA/Milano, Series E	4.00%	04/11/2024	5,881	6,016,745	0.3
Telefonica Europe BV(b)	4.38%	12/14/2024	9,400	9,725,687	0.5
Telefonica Europe BV(b)	5.88%	03/31/2024	7,100	7,521,169	0.4
United Group BV(a)	3.25%	02/15/2026	4,630	4,449,344	0.2
United Group BV	4.00%	11/15/2027	3,540	3,279,209	0.2
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.00%	01/31/2029	GBP 8,900	9,634,069	0.5
Vodafone Group PLC	4.88%	10/03/2078	6,800	8,152,160	0.4
				<u>74,942,561</u>	<u>4.0</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ</b>					
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	4.38%	05/15/2026	EUR 12,694	12,476,742	0.7
Ford Motor Credit Co. LLC, Series E	4.54%	03/06/2025	GBP 6,650	8,072,345	0.4
IHO Verwaltungs GmbH(c)	3.63%	05/15/2025	EUR 4,081	4,040,006	0.2
IHO Verwaltungs GmbH(c)	3.75%	09/15/2026	6,498	6,415,778	0.3
Jaguar Land Rover Automotive PLC	4.50%	07/15/2028	1,951	1,849,867	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	11/15/2024	3,971	4,099,957	0.2
Jaguar Land Rover Automotive PLC	6.88%	11/15/2026	4,070	4,325,261	0.2
Schaeffler AG, Series E	3.38%	10/12/2028	2,900	2,936,122	0.2
TI Automotive Finance PLC	3.75%	04/15/2029	5,022	4,695,570	0.3
				<u>48,911,648</u>	<u>2.6</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG</b>					
Carnival Corp. ....	7.63%	03/01/2026	EUR 1,000	€ 1,037,500	0.1%
Carnival Corp. ....	10.13%	02/01/2026	6,790	7,502,950	0.4
CPUK Finance Ltd. ....	4.50%	08/28/2027	GBP 4,577	5,339,047	0.3
CPUK Finance Ltd. ....	4.88%	08/28/2025	3,550	4,154,076	0.2
Deuce Finco PLC(a) ....	4.75%	06/15/2027	EUR 4,100	4,083,395	0.2
Explorer II AS ....	3.38%	02/24/2025	3,470	3,132,329	0.2
Motion Bondco DAC. ....	4.50%	11/15/2027	4,000	3,699,202	0.2
				<u>28,948,499</u>	<u>1.6</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Accor SA(b) ....	2.63%	01/30/2025	2,300	2,127,722	0.1
Cirsa Finance International SARL. ....	4.75%	05/22/2025	1,840	1,789,868	0.1
Cirsa Finance International SARL. ....	6.25%	12/20/2023	2,378	2,377,677	0.1
International Game Technology PLC ....	3.50%	06/15/2026	5,130	5,092,232	0.3
LHMC Finco 2 SARL(c) ....	7.25%	10/02/2025	7,195	6,882,800	0.4
Maison Finco PLC ....	6.00%	10/31/2027	GBP 4,713	5,578,591	0.3
NH Hotel Group SA. ....	4.00%	07/02/2026	EUR 5,580	5,459,372	0.3
				<u>29,308,262</u>	<u>1.6</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS</b>					
Punch Finance PLC ....	6.13%	06/30/2026	GBP 2,800	3,266,954	0.2
Stonegate Pub Co Financing 2019 PLC. ....	8.00%	07/13/2025	4,430	5,366,506	0.3
				<u>8,633,460</u>	<u>0.5</u>
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
CT Investment GmbH ....	5.50%	04/15/2026	EUR 2,278	2,186,702	0.1
eG Global Finance PLC. ....	4.38%	02/07/2025	3,004	2,872,656	0.2
Marks & Spencer PLC ....	4.50%	07/10/2027	GBP 5,100	6,107,777	0.3
Maxeda DIY Holding BV ....	5.88%	10/01/2026	EUR 3,290	3,171,460	0.2
Shiba Bidco SpA ....	4.50%	10/31/2028	3,329	3,205,562	0.2
				<u>17,544,157</u>	<u>1.0</u>
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Bellis Acquisition Co. PLC ....	4.50%	02/16/2026	GBP 2,649	3,003,117	0.2
Cheplapharm Arzneimittel GmbH ....	3.50%	02/11/2027	EUR 11,398	10,874,356	0.6
Cheplapharm Arzneimittel GmbH ....	4.38%	01/15/2028	3,897	3,771,966	0.2
Chrome Holdco SASU. ....	5.00%	05/31/2029	5,920	5,431,123	0.3
Cidron Aida Finco SARL. ....	5.00%	04/01/2028	6,344	5,838,171	0.3
Grifols Escrow Issuer SA. ....	3.88%	10/15/2028	7,337	6,734,932	0.4
Gruenthal GmbH ....	4.13%	05/15/2028	5,378	5,121,061	0.3
Iceland Bondco PLC ....	4.38%	05/15/2028	GBP 4,300	4,364,663	0.2
Nidda BondCo GmbH ....	7.25%	09/30/2025	EUR 3,860	3,706,510	0.2
Nobel Bidco BV. ....	3.13%	06/15/2028	3,499	3,160,955	0.2
Paysafe Finance PLC/Paysafe Holdings US Corp. ....	3.00%	06/15/2029	7,670	6,672,900	0.3
Quatrim SASU. ....	5.88%	01/15/2024	3,965	3,921,452	0.2
Rossini SARL ....	6.75%	10/30/2025	3,780	3,869,127	0.2
				<u>66,470,333</u>	<u>3.6</u>
<b>ENERGIE</b>					
Cullinan Holdco Scsp(a) ....	4.75%	10/15/2026	4,535	4,312,088	0.2
<b>SONSTIGE INDUSTRIEWERTE</b>					
Belden, Inc. ....	3.38%	07/15/2027	10,371	9,920,620	0.5
Paganini Bidco SpA(a) ....	4.25%	10/30/2028	3,450	3,436,079	0.2
Parts Europe SA(a) ....	4.00%	07/20/2027	3,300	3,296,955	0.2
Parts Europe SA. ....	6.50%	07/16/2025	9,055	9,310,659	0.5
ProGroup AG ....	3.00%	03/31/2026	3,149	3,035,428	0.2
SIG PLC. ....	5.25%	11/30/2026	5,980	5,726,267	0.3
				<u>34,726,008</u>	<u>1.9</u>
<b>DIENSTLEISTUNGEN</b>					
APCOA Parking Holdings GmbH ....	4.63%	01/15/2027	7,715	7,329,250	0.4
Elior Group SA ....	3.75%	07/15/2026	4,282	4,056,408	0.2
Intertrust Group BV. ....	3.38%	11/15/2025	10,020	10,027,569	0.5
La Financiere Atalian SASU ....	6.63%	05/15/2025	GBP 3,825	4,281,751	0.2
Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH. ....	6.00%	07/30/2026	EUR 3,335	3,361,600	0.2
Verisure Midholding AB ....	5.25%	02/15/2029	5,233	4,920,113	0.3
				<u>33,976,691</u>	<u>1.8</u>
<b>TECHNOLOGIE</b>					
Boxer Parent Co., Inc. ....	6.50%	10/02/2025	6,856	6,998,734	0.4
Brunello Bidco SpA. ....	3.50%	02/15/2028	3,307	3,086,120	0.2
Brunello Bidco SpA(a) ....	3.75%	02/15/2028	6,330	6,251,244	0.3
Cedacri Mergeco SpA(a) ....	4.63%	05/15/2028	7,968	7,891,322	0.4
Centurion Bidco SpA. ....	5.88%	09/30/2026	10,100	9,935,307	0.5
Playtech PLC ....	4.25%	03/07/2026	5,253	5,239,867	0.3
				<u>39,402,594</u>	<u>2.1</u>



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc. ....	5.25%	10/15/2026	EUR 3,648	€ 3,590,554	0.2%
Avis Budget Finance PLC .....	4.75%	01/30/2026	5,728	5,759,166	0.3
BCP V Modular Services Finance PLC .....	6.75%	11/30/2029	8,029	7,348,527	0.4
CMA CGM SA .....	7.50%	01/15/2026	5,000	5,387,991	0.3
EC Finance PLC .....	3.00%	10/15/2026	2,162	2,138,418	0.1
Gatwick Airport Finance PLC .....	4.38%	04/07/2026	GBP 5,600	6,434,971	0.4
Kapla Holding SAS(a) .....	3.25%	12/15/2026	EUR 4,500	4,343,313	0.2
Kapla Holding SAS .....	3.38%	12/15/2026	2,722	2,560,167	0.1
Loxam SAS .....	3.75%	07/15/2026	3,237	3,148,310	0.2
Loxam SAS .....	4.50%	02/15/2027	1,741	1,723,649	0.1
Loxam SAS .....	6.00%	04/15/2025	4,917	4,891,376	0.3
				<u>47,326,442</u>	<u>2.6</u>
				<u>627,980,484</u>	<u>33.9</u>
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
Abanca Corp. Bancaria SA(b) .....	6.00%	01/20/2026	5,600	5,545,460	0.3
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(b) .....	5.88%	05/24/2022	3,200	3,209,748	0.2
Banco de Credito Social Cooperativo SA, Series E .....	5.25%	11/27/2031	2,200	2,124,385	0.1
Banco de Sabadell SA, Series E .....	5.63%	05/06/2026	7,100	7,625,213	0.4
Bank of Ireland, Series E .....	10.00%	12/19/2022	6,205	6,656,035	0.4
Bank of Ireland Group PLC(b) .....	7.50%	05/19/2025	5,500	5,990,224	0.3
Bankinter SA(b) .....	6.25%	01/17/2026	3,800	4,018,599	0.2
CaixaBank SA(b) .....	5.88%	10/09/2027	4,600	4,870,250	0.3
CaixaBank SA(b) .....	6.75%	06/13/2024	7,000	7,416,673	0.4
Commerzbank AG(b) .....	6.13%	10/09/2025	4,000	4,106,514	0.2
Intesa Sanpaolo SpA, Series E .....	6.63%	09/13/2023	9,295	10,061,766	0.5
				<u>61,624,867</u>	<u>3.3</u>
<b>MAKLER</b>					
Kane Bidco Ltd. ....	6.50%	02/15/2027	GBP 1,953	2,305,495	0.1
<b>FINANZEN</b>					
LeasePlan Corp. NV(b) .....	7.38%	05/29/2024	EUR 7,000	7,460,629	0.4
Lincoln Financing SARL .....	3.63%	04/01/2024	6,722	6,718,018	0.4
				<u>14,178,647</u>	<u>0.8</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
Intesa Sanpaolo Vita SpA(b) .....	4.75%	12/17/2024	1,700	1,739,379	0.1
<b>SONSTIGE FINANZWERTE</b>					
Intrum AB .....	4.88%	08/15/2025	20,850	20,811,931	1.1
Motion Finco SARL .....	7.00%	05/15/2025	5,825	5,970,606	0.3
				<u>26,782,537</u>	<u>1.4</u>
<b>REITS</b>					
ADLER Group SA .....	1.50%	07/26/2024	4,200	3,646,107	0.2
ADLER Group SA .....	3.25%	08/05/2025	6,100	5,303,550	0.3
Aedas Homes Opco SLU .....	4.00%	08/15/2026	3,250	3,203,742	0.2
Iron Mountain UK PLC .....	3.88%	11/15/2025	GBP 14,740	17,516,949	0.9
Neinor Homes SA .....	4.50%	10/15/2026	EUR 3,180	3,109,912	0.2
Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA .....	5.25%	04/01/2026	3,250	3,240,739	0.2
Vivion Investments SARL .....	3.00%	08/08/2024	3,000	2,794,158	0.1
Vivion Investments SARL .....	3.50%	11/01/2025	1,600	1,468,070	0.1
				<u>40,283,227</u>	<u>2.2</u>
				<u>146,914,152</u>	<u>7.9</u>
<b>VERSORGUNGSBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
ContourGlobal Power Holdings SA .....	3.13%	01/01/2028	4,257	3,845,800	0.2
EDP - Energias de Portugal SA .....	4.50%	04/30/2079	6,700	6,909,375	0.4
Public Power Corp. SA .....	3.38%	07/31/2028	2,084	1,932,492	0.1
Public Power Corp. SA .....	3.88%	03/30/2026	2,385	2,291,662	0.1
				<u>14,979,329</u>	<u>0.8</u>
				<u>789,873,965</u>	<u>42.6</u>
<b>REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE</b>					
<b>FRANKREICH</b>					
French Republic Government Bond OAT .....	8.50%	04/25/2023	49,761	54,972,518	3.0
<b>DEUTSCHLAND</b>					
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe .....	6.25%	01/04/2030	61,485	91,917,173	4.9
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 97 .....	6.50%	07/04/2027	45,800	62,269,640	3.4
				<u>154,186,813</u>	<u>8.3</u>
<b>IRLAND</b>					
Ireland Government Bond .....	5.40%	03/13/2025	12,700	14,863,720	0.8

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
<b>ITALIEN</b>					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro .....	4.75%	09/01/2044	EUR 33,581	€ 48,525,470	2.6%
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro .....	7.25%	11/01/2026	22,462	29,116,711	1.6
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro .....	9.00%	11/01/2023	53,304	61,414,553	3.3
				<u>139,056,734</u>	<u>7.5</u>
<b>SPANIEN</b>					
Spain Government Bond .....	4.20%	01/31/2037	13,532	18,739,165	1.0
Spain Government Bond .....	4.90%	07/30/2040	9,198	14,295,564	0.8
Spain Government Bond .....	5.15%	10/31/2044	17,733	29,703,584	1.6
Spain Government Bond .....	5.75%	07/30/2032	19,153	28,001,108	1.5
Spain Government Bond .....	6.00%	01/31/2029	22,821	31,112,302	1.7
				<u>121,851,723</u>	<u>6.6</u>
				<u>484,931,508</u>	<u>26.2</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>BANKWESEN</b>					
ABN AMRO Bank NV, Series E .....	7.13%	07/06/2022	5,473	5,601,397	0.3
Bank of America Corp. ....	1.38%	02/07/2025	5,980	6,079,145	0.3
Barclays PLC .....	3.38%	04/02/2025	5,740	6,040,274	0.3
BNP Paribas SA(b) .....	6.13%	06/17/2022	4,521	4,566,751	0.3
CaixaBank SA, Series E .....	3.75%	02/15/2029	5,700	5,904,834	0.3
Cooperatieve Rabobank UA(b) .....	4.38%	06/29/2027	33,000	33,657,637	1.8
Erste Group Bank AG(b) .....	4.25%	10/15/2027	18,600	17,621,995	1.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The)(a) .....	0.45%	02/07/2025	6,000	6,020,562	0.3
Goldman Sachs Group, Inc. (The) .....	7.13%	08/07/2025	GBP 11,430	15,781,422	0.9
HSBC Holdings PLC(b) .....	6.00%	09/29/2023	EUR 5,281	5,537,510	0.3
HSBC Holdings PLC .....	6.75%	09/11/2028	GBP 7,050	10,015,604	0.5
HSBC Holdings PLC, Series E(b) .....	4.75%	07/04/2029	EUR 15,365	15,600,167	0.8
ING Groep NV .....	0.10%	09/03/2025	6,200	6,079,516	0.3
KBC Group NV(b) .....	4.25%	10/24/2025	6,600	6,526,328	0.4
Lloyds Banking Group PLC .....	2.71%	12/03/2035	GBP 10,214	11,292,495	0.6
Natwest Group PLC .....	2.00%	03/04/2025	EUR 5,800	5,939,572	0.3
Skandinaviska Enskilda Banken AB .....	0.75%	08/09/2027	3,784	3,690,664	0.2
Swedbank AB, Series G .....	1.30%	02/17/2027	2,040	2,034,276	0.1
UniCredit SpA(b) .....	7.50%	06/03/2026	4,780	5,147,061	0.3
UniCredit SpA, Series E .....	6.95%	10/31/2022	25,679	26,721,204	1.5
Wells Fargo & Co. ....	2.13%	06/04/2024	5,860	6,068,653	0.3
				<u>205,927,067</u>	<u>11.1</u>
<b>VERSICHERUNGEN</b>					
ASR Nederland NV .....	3.38%	05/02/2049	13,599	13,880,126	0.7
Assicurazioni Generali SpA(b) .....	6.27%	06/16/2026	GBP 3,000	3,778,978	0.2
Assicurazioni Generali SpA, Series E .....	5.50%	10/27/2047	EUR 12,804	14,224,391	0.8
CNP Assurances(b) .....	4.75%	06/27/2028	12,000	12,399,345	0.7
Credit Agricole Assurances SA(b) .....	4.25%	01/13/2025	1,900	1,980,470	0.1
Credit Agricole Assurances SA .....	4.75%	09/27/2048	5,200	5,733,312	0.3
Liberty Mutual Group, Inc. ....	3.63%	05/23/2059	14,951	14,857,644	0.8
Storebrand Livsforsikring AS .....	6.88%	04/04/2043	4,370	4,582,420	0.2
				<u>71,436,686</u>	<u>3.8</u>
<b>REITS</b>					
Digital Stout Holding LLC .....	3.75%	10/17/2030	GBP 3,250	4,124,396	0.2
Summit Properties Ltd. ....	2.00%	01/31/2025	EUR 3,052	2,933,276	0.2
				<u>7,057,672</u>	<u>0.4</u>
				<u>284,421,425</u>	<u>15.3</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Glencore Finance Europe Ltd., Series E .....	3.13%	03/26/2026	GBP 2,430	2,963,060	0.2
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
GE Capital UK Funding Unlimited. Co., Series E .....	5.88%	01/18/2033	7,405	10,965,614	0.6
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Pinewood Finance Co., Ltd. ....	3.63%	11/15/2027	4,700	5,311,321	0.3
Sky Ltd. ....	6.00%	05/21/2027	5,000	7,117,413	0.4
Time Warner Cable LLC .....	5.25%	07/15/2042	10,160	14,024,805	0.7
				<u>26,453,539</u>	<u>1.4</u>
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
AT&T, Inc. ....	5.50%	03/15/2027	3,750	5,156,108	0.3
AT&T, Inc., Series B(b) .....	2.88%	03/02/2025	EUR 1,900	1,829,832	0.1
AT&T, Inc., Series E .....	7.00%	04/30/2040	GBP 2,900	5,017,710	0.3
Orange SA, Series E .....	8.13%	11/20/2028	7,247	11,762,684	0.6
				<u>23,766,334</u>	<u>1.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG</b>					
CPUK Finance Ltd. ....	7.24%	02/28/2024	GBP 2,477	€ 3,248,944	0.2%
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Anheuser-Busch InBev SA/NV, Series E .....	9.75%	07/30/2024	11,922	16,859,996	0.9
British American Tobacco PLC, Series 5.25(b) .....	3.00%	09/27/2026	EUR 4,796	4,348,285	0.2
				<u>21,208,281</u>	<u>1.1</u>
<b>ENERGIE</b>					
BP Capital Markets PLC(b) .....	3.25%	03/22/2026	2,295	2,271,746	0.1
<b>SONSTIGE INDUSTRIEWERTE</b>					
Travis Perkins PLC .....	4.50%	09/07/2023	GBP 8,067	9,640,101	0.5
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Heathrow Funding Ltd. ....	5.23%	02/15/2023	2,680	3,306,853	0.2
				<u>103,824,472</u>	<u>5.6</u>
<b>VERSORGBETRIEBE</b>					
<b>ELEKTRIZITÄT</b>					
EDP Finance BV, Series E .....	8.63%	01/04/2024	9,146	12,261,398	0.7
Electricite de France SA, Series E(b) .....	5.38%	01/29/2025	EUR 8,000	8,101,580	0.4
Enel SpA(b)(d) .....	5.45%	01/10/2024	7,010	7,379,986	0.4
Naturgy Finance BV(b) .....	3.38%	04/24/2024	2,600	2,607,148	0.2
Orsted AS(b) .....	6.25%	06/26/2013	2,330	2,453,630	0.1
				<u>32,803,742</u>	<u>1.8</u>
				<u>421,049,639</u>	<u>22.7</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Consolidated Energy Finance SA .....	5.00%	10/15/2028	3,700	3,405,317	0.2
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE</b>					
Allwyn Entertainment Financing UK PLC(a) .....	4.13%	02/15/2028	6,142	6,038,279	0.3
Sazka Group AS .....	3.88%	02/15/2027	9,355	8,910,638	0.5
				<u>14,948,917</u>	<u>0.8</u>
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV .....	4.50%	03/01/2025	3,495	3,473,812	0.2
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV .....	6.00%	01/31/2025	6,247	6,457,955	0.3
				<u>9,930,867</u>	<u>0.5</u>
				<u>28,285,101</u>	<u>1.5</u>
<b>ABS-ANLEIHEN</b>					
<b>SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS</b>					
Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO					
Series 2022-3, Class A(a) .....	0.00%	10/25/2034	3,700	3,700,000	0.2
Series 2022-3, Class D(a) .....	0.00%	10/25/2034	12,400	12,400,000	0.7
				<u>16,100,000</u>	<u>0.9</u>
<b>GEDECKTE ANLEIHEN</b>					
Canadian Imperial Bank of Commerce .....	0.01%	10/07/2026	5,680	5,550,469	0.3
Commonwealth Bank of Australia .....	0.75%	02/28/2028	3,800	3,812,452	0.2
Danske Mortgage Bank PLC .....	0.01%	11/24/2026	500	489,353	0.0
Royal Bank of Canada .....	0.01%	01/21/2027	3,150	3,068,704	0.2
				<u>12,920,978</u>	<u>0.7</u>
<b>REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN</b>					
<b>KANADA</b>					
Export Development Canada .....	0.50%	02/25/2027	4,769	4,797,704	0.3
				<u>1,757,958,895</u>	<u>94.9</u>
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>GRUNDSTOFFE</b>					
Kleopatra Finco SARL .....	4.25%	03/01/2026	7,650	6,847,044	0.4
<b>INVESTITIONSGÜTER</b>					
Titan Holdings II BV .....	5.13%	07/15/2029	11,000	10,042,507	0.5
<b>KOMMUNIKATIONSMEDIEN</b>					
Summer BidCo BV(c) .....	9.00%	11/15/2025	6,806	6,789,371	0.4
<b>KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION</b>					
Hellas Telecommunications/Luxembourg III(e) .....	8.50%	10/15/2049	641	0	0.0
<b>KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER</b>					
BK LC Lux Finco I SARL .....	5.25%	04/30/2029	7,510	7,295,266	0.4
Constellation Automotive Financing PLC .....	4.88%	07/15/2027	GBP 2,462	2,709,457	0.1
				<u>10,004,723</u>	<u>0.5</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (EUR)	Nettovermögen %
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Picard Bondco SA .....	5.38%	07/01/2027	EUR 4,423	€ 4,221,648	0.2%
<b>DIENSTLEISTUNGEN</b>					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL .....	4.88%	06/01/2028	GBP 6,524	7,171,327	0.4
<b>TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN</b>					
BCP V Modular Services Finance II PLC .....	6.13%	11/30/2028	9,800	10,933,598	0.6
				56,010,218	3.0
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>CLO – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Richmond Park CLO 1 DAC, Series 1X, Class DRR(a) .....	3.05%	07/14/2031	EUR 2,300	2,275,461	0.1
<b>STAMMAKTIEN</b>					
K201640219 South Africa Ltd. A Shares(e) .....			18,654,746	17	0.0
<b>REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN</b>					
<b>NIEDERLANDE</b>					
SNS Reaal NV(b)(e) .....			770,000	1	0.0
				58,285,697	3.1
<b>Gesamtanlagen</b>					
(Kosten €1,939,788,239) .....				€ 1,816,244,592	98.0%
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(f) .....	(0.21)%	–		15,456	0.0
BNP Paribas, Paris(f) .....	0.01 %	–		2,128	0.0
BNP Paribas, Paris(f) .....	0.07 %	–		139	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Singapore(f) .....	0.08 %	–		24	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(f) .....	(0.78)%	–		6,426,562	0.3
Royal Bank of Canada, Toronto(f) .....	0.01 %	–		874,267	0.1
Sumitomo, London(f) .....	0.10 %	–		187,692	0.0
<b>Termineinlagen insgesamt</b> .....				7,506,268	0.4
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b> .....				30,392,442	1.6
<b>Nettovermögen</b> .....				€ 1,854,143,302	100.0%

**TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
<b>Long</b>					
Euro Buxl 30 Yr Bond Futures .....	03/08/2022	577	€ 125,243,820	€ 114,119,060	€ (11,124,760)
Euro-BOBL Futures .....	03/08/2022	119	15,990,030	15,691,340	(298,690)
Euro-BTP Futures .....	03/08/2022	354	52,919,640	49,967,100	(2,952,540)
Euro-OAT Futures .....	03/08/2022	138	22,916,260	21,842,640	(1,073,620)
<b>Short</b>					
Euro-Bund Futures .....	03/08/2022	855	144,075,210	142,819,200	1,256,010
Euro-Schatz Futures .....	03/08/2022	416	46,570,450	46,587,840	(17,390)
Long Gilt Futures .....	06/28/2022	447	65,351,273	65,823,840	(472,567)
					€ (14,683,557)
				Wertsteigerung	€ 1,256,010
				Wertminderung	€ (15,939,567)

**DEWISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
BNP Paribas SA .....	GBP 4,217	EUR 5,014	03/17/2022	€ (28,361)
Brown Brothers Harriman & Co. ....	EUR 9,612	GBP 8,083	03/17/2022	54,502
Brown Brothers Harriman & Co. ....	EUR 9,582	GBP 8,006	03/17/2022	(7,803)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	AUD 207,315	EUR 132,731	03/02/2022	(1,558,630)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	CHF 2,900	EUR 2,799	03/02/2022	(21,461)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 130,782	AUD 207,315	03/02/2022	3,508,234
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 2,765	CHF 2,900	03/02/2022	55,695
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 58,013	HKD 511,597	03/02/2022	374,058
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 64	PLN 293	03/02/2022	(2,010)
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 7,849	SGD 11,966	03/02/2022	22,324
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	EUR 1,175,167	USD 1,330,580	03/02/2022	11,526,405
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	HKD 511,597	EUR 58,473	03/02/2022	85,507
Brown Brothers Harriman & Co.+ .....	PLN 293	EUR 63	03/02/2022	1,079

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 11,966	EUR 7,879	03/02/2022	€ 7,715
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 1,330,580	EUR 1,187,514	03/02/2022	820,949
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CNH 339	EUR 48	03/04/2022	177
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CNH 5,492	EUR 754	03/04/2022	(20,651)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 4,832	CNH 34,630	03/04/2022	53,691
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 79,784	HKD 706,222	03/04/2022	809,488
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 24,657	HKD 215,697	03/04/2022	(42,163)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 1,287,537	USD 1,461,752	03/04/2022	16,047,095
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 405,727	USD 454,501	03/04/2022	(404,572)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	HKD 3,166	EUR 362	03/04/2022	614
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	HKD 703,159	EUR 79,434	03/04/2022	(810,148)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 4,881	EUR 4,357	03/04/2022	4,286
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 1,457,834	EUR 1,284,035	03/04/2022	(16,054,925)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CNH 339	EUR 48	03/14/2022	175
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CNH 479	EUR 66	03/14/2022	(1,575)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 4,197	CNH 30,579	03/14/2022	111,260
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 69,342	HKD 613,533	03/14/2022	644,379
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 33,815	HKD 295,899	03/14/2022	(62,033)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 200	PLN 912	03/14/2022	(6,341)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 12,009	SGD 18,342	03/14/2022	50,819
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 5,871	SGD 8,915	03/14/2022	(9,404)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 818,864	USD 929,082	03/14/2022	9,334,333
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 395,015	USD 442,631	03/14/2022	(447,287)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	HKD 3,166	EUR 362	03/14/2022	662
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	HKD 610,471	EUR 68,992	03/14/2022	(645,085)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	PLN 669	EUR 147	03/14/2022	5,333
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 56	EUR 37	03/14/2022	59
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 18,309	EUR 11,987	03/14/2022	(50,916)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 4,881	EUR 4,356	03/14/2022	4,970
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 925,164	EUR 815,362	03/14/2022	(9,342,677)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD 210,361	EUR 132,730	03/18/2022	(3,472,433)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CHF 2,985	EUR 2,846	03/18/2022	(57,133)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 264,969	AUD 416,908	03/18/2022	4,966,561
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 5,645	CHF 5,885	03/18/2022	78,786
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 2,091	SGD 3,194	03/18/2022	8,479
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 2,009	SGD 3,050	03/18/2022	(3,349)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 396,263	USD 450,426	03/18/2022	5,175,971
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 386,772	USD 433,447	03/18/2022	(465,252)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 56	EUR 37	03/18/2022	62
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 3,161	EUR 2,069	03/18/2022	(8,578)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 4,881	EUR 4,355	03/18/2022	5,314
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 446,507	EUR 392,762	03/18/2022	(5,184,596)
HSBC Bank USA.....	EUR 2,750	GBP 2,307	03/17/2022	8,911
JPMorgan Chase Bank, NA.....	EUR 4,158	GBP 3,476	03/17/2022	(2,037)
Royal Bank of Scotland PLC.....	GBP 268,888	EUR 321,949	03/17/2022	406,555
Societe Generale.....	GBP 1,693	EUR 2,030	03/17/2022	5,749
				<u>€ 15,470,777</u>
			Wertsteigerung	€ 54,180,197
			Wertminderung	€ (38,709,420)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

- (a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2022.
- (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) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 28. Februar 2022.
- (e) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (f) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
- CHF – Swiss Franc
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- EUR – Euro
- GBP – Great British Pound
- HKD – Hong Kong Dollar
- PLN – Polish Zloty

SGD – Singapore Dollar  
USD – United States Dollar

Glossar:

ABS – Asset-Backed Securities  
BOBL – Bundesobligationen  
BTP – Buoni del Tesoro Poliennali  
CLO – Collateralized Loan Obligations  
REIT – Real Estate Investment Trust  
OAT – Obligations Assimilables du Trésor

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>					
<b>STAATSANLEIHEN</b>					
Abu Dhabi Government International Bond	3.13%	10/11/2027	USD 1,620	\$ 1,696,950	0.3%
Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049	8,217	7,621,267	1.2
Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048	5,404	5,106,780	0.8
Angolan Government International Bond	9.50%	11/12/2025	2,157	2,307,990	0.4
Argentine Republic Government International Bond	0.50%	07/09/2030	20,774	6,626,824	1.0
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	3,315	1,092,276	0.2
Argentine Republic Government International Bond	1.13%	07/09/2035	26,055	7,725,239	1.2
Argentine Republic Government International Bond	2.00%	01/09/2038	4,982	1,843,164	0.3
Argentine Republic Government International Bond	2.50%	07/09/2041	2,951	1,003,251	0.2
Bahamas Government International Bond	8.95%	10/15/2032	3,993	3,533,805	0.5
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	221	203,320	0.0
Bahrain Government International Bond	6.00%	09/19/2044	1,100	923,175	0.1
Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029	3,508	3,593,069	0.6
Bahrain Government International Bond	7.00%	10/12/2028	1,754	1,854,855	0.3
Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030	3,951	4,185,097	0.6
Chile Government International Bond	2.55%	01/27/2032	5,733	5,386,512	0.8
Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	10,045	8,407,665	1.3
Colombia Government International Bond	5.00%	06/15/2045	2,855	2,368,401	0.4
Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	200	179,413	0.0
Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	2,985	2,884,816	0.4
Colombia Government International Bond	7.38%	09/18/2037	2,044	2,265,391	0.3
Dominican Republic International Bond	5.50%	02/22/2029	1,105	1,099,682	0.2
Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027	4,260	4,430,400	0.7
Dominican Republic International Bond	6.50%	02/15/2048	4,179	3,922,514	0.6
Dominican Republic International Bond	6.85%	01/27/2045	3,091	3,020,100	0.5
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	179	200,928	0.0
Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	1,753	1,030,698	0.2
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2040	5,362	3,335,626	0.5
Ecuador Government International Bond	1.00%	07/31/2035	11,188	7,890,049	1.2
Ecuador Government International Bond	5.00%	07/31/2030	3,287	2,890,978	0.4
Egypt Government International Bond	5.63%	04/16/2030	EUR 3,111	2,764,405	0.4
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	USD 836	679,250	0.1
Egypt Government International Bond	7.30%	09/30/2033	3,192	2,609,460	0.4
Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	3,693	3,545,280	0.5
Egypt Government International Bond	7.50%	02/16/2061	1,883	1,346,345	0.2
Egypt Government International Bond	7.90%	02/21/2048	7,077	5,201,595	0.8
El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	3,134	1,887,843	0.3
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	3,636	1,985,710	0.3
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	7,519	3,669,272	0.5
El Salvador Government International Bond	7.63%	02/01/2041	3,310	1,660,792	0.3
El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035	506	264,480	0.0
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	1,137	622,010	0.1
Finance Department Government of Sharjah	4.00%	07/28/2050	1,063	875,846	0.1
Gabon Government International Bond	6.95%	06/16/2025	3,807	3,841,025	0.6
Ghana Government International Bond	7.63%	05/16/2029	2,108	1,422,900	0.2
Ghana Government International Bond	7.75%	04/07/2029	1,542	1,044,705	0.2
Ghana Government International Bond	7.88%	03/26/2027	3,415	2,441,725	0.4
Ghana Government International Bond	7.88%	02/11/2035	2,271	1,476,150	0.2
Ghana Government International Bond	8.13%	03/26/2032	1,700	1,139,000	0.2
Ghana Government International Bond	8.63%	04/07/2034	941	623,413	0.1
Ghana Government International Bond	8.63%	06/16/2049	2,701	1,748,897	0.3
Ghana Government International Bond	8.75%	03/11/2061	559	361,953	0.1
Ghana Government International Bond	8.95%	03/26/2051	4,142	2,692,300	0.4
Guatemala Government Bond	4.38%	06/05/2027	6,687	6,711,240	1.0
Guatemala Government Bond	4.65%	10/07/2041	728	663,754	0.1
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS	5.13%	06/22/2026	1,180	1,107,578	0.2
Honduras Government International Bond	6.25%	01/19/2027	672	605,136	0.1
Indonesia Government International Bond	4.20%	10/15/2050	1,270	1,300,302	0.2
Ivory Coast Government International Bond	5.38%	07/23/2024	3,925	3,977,252	0.6
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	7,082	6,815,540	1.0
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	4,615	4,722,587	0.7
Jamaica Government International Bond	7.88%	07/28/2045	3,368	4,413,764	0.7
Lebanon Government International Bond(a)	6.00%	01/27/2023	1,360	159,800	0.0
Lebanon Government International Bond(a)	6.65%	04/22/2024	3,748	440,390	0.1
Lebanon Government International Bond, Series E(a)	6.10%	10/04/2022	6,321	750,619	0.1
Lebanon Government International Bond, Series G(a)	1.00%	11/27/2026	1,719	201,983	0.0
Lebanon Government International Bond, Series G(a)	6.20%	02/26/2025	4,428	520,290	0.1
Lebanon Government International Bond, Series G(a)	6.85%	03/23/2027	4,936	579,980	0.1
Malaysia Wakala Sukuk Bhd	3.08%	04/28/2051	7,035	6,688,966	1.0
Mexico Government International Bond	5.00%	04/27/2051	3,181	3,223,943	0.5
Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	2,934	2,706,248	0.4
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	4,366	4,147,700	0.6
Nigeria Government International Bond	7.38%	09/28/2033	1,323	1,178,958	0.2
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/21/2025	3,635	3,853,100	0.6

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	USD 1,062	\$ 857,565	0.1%
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	2,993	2,529,085	0.4
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	1,546	1,420,388	0.2
Nigeria Government International Bond	8.25%	09/28/2051	2,024	1,735,580	0.3
Oman Government International Bond	4.75%	06/15/2026	3,674	3,664,815	0.6
Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025	1,567	1,586,587	0.2
Oman Government International Bond	5.63%	01/17/2028	481	488,215	0.1
Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	2,927	3,022,127	0.5
Oman Government International Bond	6.50%	03/08/2047	519	482,670	0.1
Oman Government International Bond	6.75%	01/17/2048	1,357	1,292,543	0.2
Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	2,613	2,416,698	0.4
Pakistan Government International Bond	7.38%	04/08/2031	3,359	2,880,712	0.4
Pakistan Government International Bond	8.25%	04/15/2024	200	202,850	0.0
Pakistan Government International Bond	8.88%	04/08/2051	1,050	861,116	0.1
Panama Bonos del Tesoro, Series DOM	3.36%	06/30/2031	1,156	1,115,540	0.2
Panama Government International Bond	3.87%	07/23/2060	1,270	1,085,691	0.2
Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026	2,770	2,837,172	0.4
Paraguay Government International Bond	3.85%	06/28/2033	1,929	1,834,117	0.3
Paraguay Government International Bond	4.95%	04/28/2031	1,330	1,380,124	0.2
Paraguay Government International Bond	5.00%	04/15/2026	3,324	3,470,048	0.5
Philippine Government International Bond	3.00%	02/01/2028	1,805	1,820,992	0.3
Philippine Government International Bond	3.20%	07/06/2046	3,472	3,064,422	0.5
Philippine Government International Bond	3.75%	01/14/2029	745	775,813	0.1
Philippine Government International Bond	5.50%	03/30/2026	918	1,015,638	0.2
Qatar Government International Bond	4.40%	04/16/2050	8,225	9,510,156	1.5
Qatar Government International Bond	5.10%	04/23/2048	3,138	3,934,267	0.6
Republic of Kenya Government International Bond	6.88%	06/24/2024	2,701	2,795,535	0.4
Republic of South Africa Government International Bond	5.00%	10/12/2046	1,191	970,144	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	5.38%	07/24/2044	2,133	1,854,110	0.3
Republic of South Africa Government International Bond	5.65%	09/27/2047	1,539	1,318,538	0.2
Romanian Government International Bond	4.00%	02/14/2051	2,100	1,774,500	0.3
Russian Foreign Bond - Eurobond	5.25%	06/23/2047	12,800	3,840,000	0.6
Saudi Government International Bond	2.88%	03/04/2023	700	709,450	0.1
Saudi Government International Bond	3.45%	02/02/2061	1,435	1,307,644	0.2
Saudi Government International Bond	5.00%	04/17/2049	1,617	1,877,741	0.3
Saudi Government International Bond	5.25%	01/16/2050	2,098	2,533,335	0.4
Senegal Government International Bond	4.75%	03/13/2028	EUR 789	830,480	0.1
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	USD 5,819	4,905,417	0.8
Sharjah Sukuk Ltd.	3.76%	09/17/2024	796	826,049	0.1
Sri Lanka Government International Bond	6.20%	05/11/2027	1,616	719,298	0.1
Sri Lanka Government International Bond	6.85%	11/03/2025	5,158	2,470,360	0.4
Sri Lanka Government International Bond	7.55%	03/28/2030	273	120,257	0.0
Sri Lanka Government International Bond	7.85%	03/14/2029	2,709	1,199,240	0.2
Turkey Government International Bond	4.25%	03/13/2025	2,374	2,195,653	0.3
Turkey Government International Bond	4.75%	01/26/2026	2,344	2,133,040	0.3
Turkey Government International Bond	4.88%	04/16/2043	1,566	1,086,217	0.2
Turkey Government International Bond	5.75%	05/11/2047	4,881	3,504,558	0.5
Turkey Government International Bond	6.63%	02/17/2045	1,430	1,142,481	0.2
Ukraine Government International Bond	6.88%	05/21/2029	2,527	783,370	0.1
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2032	1,405	449,600	0.1
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2024	5,724	1,831,680	0.3
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2026	7,740	2,476,800	0.4
Ukraine Government International Bond	8.99%	02/01/2024	1,750	595,000	0.1
Ukraine Government International Bond	9.75%	11/01/2028	763	244,160	0.0
Ukraine Government International Bond, Series GDP(b)	0.00%	05/31/2040	7,508	1,126,200	0.2
Uruguay Government International Bond	4.98%	04/20/2055	743	876,559	0.1
Uruguay Government International Bond	5.10%	06/18/2050	2,094	2,493,237	0.4
Venezuela Government International Bond(c)	7.75%	10/13/2019	2,834	162,944	0.0
Venezuela Government International Bond(a)	9.00%	05/07/2023	5,842	321,332	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	9.25%	09/15/2027	4,619	254,045	0.0
Venezuela Government International Bond(a)	9.25%	05/07/2028	8,171	449,416	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	11.95%	08/05/2031	762	41,894	0.0
Venezuela Government International Bond(a)	12.75%	08/23/2022	2,087	114,807	0.0
Zambia Government International Bond(a)	8.97%	07/30/2027	9,901	7,279,091	1.1
				312,202,834	48.0
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
Absa Group Ltd.(d)	6.38%	05/27/2026	638	623,645	0.1
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	1,800	1,651,680	0.3
Adani Green Energy Ltd.	4.38%	09/08/2024	200	197,310	0.0
AES Andes SA	6.35%	10/07/2079	1,162	1,163,452	0.2
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	05/31/2030	1,353	1,305,780	0.2
Agile Group Holdings Ltd.	4.85%	08/31/2022	200	113,663	0.0
Agile Group Holdings Ltd.	5.50%	05/17/2026	230	85,100	0.0
Alfa Desarrollo SpA	4.55%	09/27/2051	1,870	1,598,850	0.3
Autopistas del Sol SA/Costa Rica	7.38%	12/30/2030	2,080	2,053,415	0.3



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Bangkok Bank PCL/Hong Kong	3.73%	09/25/2034	USD 2,429	\$ 2,368,730	0.4%
Bank Hapoalim BM	3.26%	01/21/2032	2,537	2,438,691	0.4
Bidvest Group UK PLC (The)	3.63%	09/23/2026	1,684	1,608,220	0.3
Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.	0.00%	06/05/2034	2,128	1,565,329	0.2
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	1,110	1,060,050	0.2
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	1,944	1,930,392	0.3
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028	1,745	1,753,638	0.3
BRF SA	4.88%	01/24/2030	1,825	1,732,974	0.3
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	542	542,678	0.1
Celulosa Arauco y Constitucion SA	4.20%	01/29/2030	1,088	1,096,024	0.2
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	2,148	2,295,782	0.4
Central American Bottling Corp./CBC Bottling Holdeco SL/ Beliv Holdco SL	5.25%	04/27/2029	638	646,166	0.1
Central China Real Estate Ltd.	7.25%	04/24/2023	248	136,400	0.0
Central China Real Estate Ltd.	7.50%	07/14/2025	530	233,200	0.0
Central China Real Estate Ltd.	7.75%	05/24/2024	200	90,000	0.0
Central China Real Estate Ltd.	7.90%	11/07/2023	202	94,940	0.0
Chile Electricity PEC SpA	0.00%	01/25/2028	3,495	2,562,927	0.4
China Aoyuan Group Ltd.(a)	5.88%	03/01/2027	1,055	184,625	0.0
China Cinda 2020 I Management Ltd.	3.00%	01/20/2031	322	294,992	0.1
China Cinda Finance 2017 I Ltd.	4.40%	03/09/2027	967	1,011,905	0.2
China Evergrande Group(a)	7.50%	06/28/2023	560	81,200	0.0
China SCE Group Holdings Ltd.	6.00%	02/04/2026	780	436,800	0.1
China SCE Group Holdings Ltd.	7.00%	05/02/2025	200	116,000	0.0
CIFI Holdings Group Co., Ltd.	4.80%	05/17/2028	200	147,500	0.0
Country Garden Holdings Co., Ltd.	3.13%	10/22/2025	200	140,900	0.0
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	1,323	1,198,175	0.2
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	5,220	5,452,290	0.8
Ecopetrol SA	7.38%	09/18/2043	2,435	2,408,215	0.4
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	2,350	2,345,594	0.4
Empresa Generadora de Electricidad Haina SA	5.63%	11/08/2028	1,399	1,378,015	0.2
Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA	3.05%	09/14/2032	4,024	3,686,990	0.6
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	2,504	2,211,721	0.3
Enel Chile SA	4.88%	06/12/2028	1,677	1,784,747	0.3
Gran Colombia Gold Corp.	6.88%	08/09/2026	2,400	2,257,616	0.4
Gran Tierra Energy International Holdings Ltd.	6.25%	02/15/2025	2,855	2,588,777	0.4
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	807	732,672	0.1
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	3.75%	04/27/2022	1,104	1,104,000	0.2
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	4.75%	04/27/2027	700	675,500	0.1
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.25%	11/13/2024	465	441,750	0.1
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.75%	05/29/2024	227	221,325	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	4.50%	05/29/2029	1,047	978,945	0.2
IHS Holding Ltd.	5.63%	11/29/2026	1,128	1,102,620	0.2
India Clean Energy Holdings	4.50%	04/18/2027	1,455	1,378,612	0.2
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Series E	7.13%	10/10/2022	INR 160,000	2,126,680	0.3
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	USD 601	588,980	0.1
Inkia Energy Ltd.	5.88%	11/09/2027	1,179	1,147,904	0.2
Intercorp Financial Services, Inc.	4.13%	10/19/2027	1,268	1,228,216	0.2
Israel Electric Corp. Ltd., Series G	3.75%	02/22/2032	204	202,404	0.0
JSW Hydro Energy Ltd.	4.13%	05/18/2031	386	356,085	0.1
JSW Infrastructure Ltd.	4.95%	01/21/2029	1,201	1,163,694	0.2
Kaisa Group Holdings Ltd.(a)	9.95%	07/23/2025	550	123,509	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(a)	10.50%	01/15/2025	434	95,480	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(a)	11.65%	06/01/2026	200	44,788	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(a)	11.70%	11/11/2025	376	84,201	0.0
Kosmos Energy Ltd.	7.50%	03/01/2028	1,428	1,331,610	0.2
KWG Group Holdings Ltd.	5.95%	08/10/2025	330	132,000	0.0
KWG Group Holdings Ltd.	6.00%	08/14/2026	441	176,480	0.0
KWG Group Holdings Ltd.	7.40%	01/13/2027	204	80,580	0.0
Leviathan Bond Ltd.	6.75%	06/30/2030	1,415	1,419,002	0.2
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	3,198	3,499,900	0.5
Logan Group Co., Ltd.	4.50%	01/13/2028	200	56,000	0.0
Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026	1,315	1,324,862	0.2
Melco Resorts Finance Ltd.	5.75%	07/21/2028	1,055	948,709	0.2
Minejesa Capital BV	5.63%	08/10/2037	1,680	1,583,190	0.2
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	564	545,906	0.1
National Central Cooling Co. PJSC	2.50%	10/21/2027	974	919,213	0.1
NBM US Holdings, Inc.	7.00%	05/14/2026	2,240	2,318,120	0.4
Nexa Resources SA	6.50%	01/18/2028	1,521	1,584,026	0.2
OEC Finance Ltd.(e)	4.38%	10/25/2029	277	11,349	0.0
OEC Finance Ltd.	4.38%	10/25/2029	643	26,371	0.0
OEC Finance Ltd.(e)	5.25%	12/27/2033	1,525	59,665	0.0
OEC Finance Ltd.(e)	7.13%	12/26/2046	524	21,499	0.0
Oi Movel SA	8.75%	07/30/2026	1,773	1,810,455	0.3
Peru LNG Srl	5.38%	03/22/2030	3,190	2,752,970	0.4

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Petrobras Global Finance BV	7.38%	01/17/2027	USD 6,252	\$ 6,994,425	1.1%
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	4.90%	05/13/2026	200	90,000	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	5.95%	04/30/2025	220	105,600	0.0
Prosus NV	3.26%	01/19/2027	953	912,795	0.1
Prosus NV	3.68%	01/21/2030	2,435	2,175,977	0.3
Prosus NV	4.03%	08/03/2050	620	480,500	0.1
PTTEP Treasury Center Co., Ltd.	3.90%	12/06/2059	986	951,549	0.2
Ronshine China Holdings Ltd.	7.10%	01/25/2025	1,030	221,450	0.0
Ronshine China Holdings Ltd.	8.10%	06/09/2023	289	70,805	0.0
Rutas 2 and 7 Finance Ltd.	0.00%	09/30/2036	1,535	1,112,875	0.2
Scenery Journey Ltd.(a)	11.50%	10/24/2022	794	75,430	0.0
Scenery Journey Ltd.(a)	12.00%	10/24/2023	1,106	105,070	0.0
Seazen Group Ltd.	4.45%	07/13/2025	915	484,950	0.1
SEPLAT Energy PLC	7.75%	04/01/2026	1,894	1,846,650	0.3
Shimao Group Holdings Ltd.	5.20%	01/16/2027	400	112,000	0.0
SierraCol Energy Andina LLC.	6.00%	06/15/2028	1,092	992,093	0.2
SK Hynix, Inc.	2.38%	01/19/2031	2,214	2,020,474	0.3
Stillwater Mining Co.	4.00%	11/16/2026	3,341	3,199,007	0.5
Studio City Co., Ltd.	7.00%	02/15/2027	254	250,647	0.0
Studio City Finance Ltd.	6.50%	01/15/2028	830	726,250	0.1
Sunac China Holdings Ltd.	5.95%	04/26/2024	250	97,500	0.0
Sunac China Holdings Ltd.	6.50%	01/10/2025	280	106,400	0.0
Sunac China Holdings Ltd.	6.50%	01/26/2026	200	75,000	0.0
Sunac China Holdings Ltd.	7.00%	07/09/2025	280	106,400	0.0
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	3.25%	08/15/2030	2,279	2,051,100	0.3
Times China Holdings Ltd.	5.55%	06/04/2024	250	97,500	0.0
Times China Holdings Ltd.	5.75%	01/14/2027	530	180,200	0.0
Times China Holdings Ltd.	6.20%	03/22/2026	200	70,000	0.0
Times China Holdings Ltd.	6.75%	07/08/2025	200	72,000	0.0
TransJamaican Highway Ltd.	5.75%	10/10/2036	1,829	1,809,159	0.3
Tullow Oil PLC	10.25%	05/15/2026	3,609	3,500,730	0.5
UEP Penonome II SA	6.50%	10/01/2038	3,596	3,703,515	0.6
Vedanta Resources Finance II PLC	13.88%	01/21/2024	4,356	4,426,785	0.7
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026	1,675	1,591,041	0.2
Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	1,100	948,530	0.1
Xiaomi Best Time International Ltd.	2.88%	07/14/2031	2,652	2,417,961	0.4
Yango Justice International Ltd.	7.50%	02/17/2025	925	120,250	0.0
Yango Justice International Ltd.	8.25%	11/25/2023	200	26,000	0.0
Yango Justice International Ltd.	9.25%	04/15/2023	530	68,900	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.	6.35%	01/13/2027	730	116,800	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.	7.38%	01/13/2026	220	38,198	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.	7.70%	02/20/2025	200	32,000	0.0
Zhenro Properties Group Ltd.	6.63%	01/07/2026	245	26,950	0.0
Zhenro Properties Group Ltd.	6.70%	08/04/2026	485	53,350	0.0
Zhenro Properties Group Ltd.	7.10%	09/10/2024	270	31,969	0.0
Zorlu Yenilenebilir Enerji AS	9.00%	06/01/2026	3,285	2,891,416	0.4
				<u>140,662,571</u>	<u>21.6</u>
<b>QUASI-STAAATSANLEIHEN</b>					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	5.13%	08/11/2061	836	757,782	0.1
Airport Authority(d)	2.40%	03/08/2028	2,978	2,800,809	0.4
Banco Nacional De Panama	2.50%	08/11/2030	2,321	2,037,838	0.3
Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	2,867	2,543,208	0.4
Comision Federal de Electricidad	4.68%	02/09/2051	1,193	982,957	0.2
Comision Federal de Electricidad	4.69%	05/15/2029	684	684,855	0.1
Comision Federal de Electricidad	5.00%	09/29/2036	1,817	1,792,016	0.3
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.15%	01/14/2030	439	424,815	0.1
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.75%	01/15/2031	808	814,060	0.1
DP World Ltd./United Arab Emirates	5.63%	09/25/2048	1,706	1,904,323	0.3
DP World Salaam(d)	6.00%	10/01/2025	2,195	2,292,403	0.4
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	5.00%	01/25/2047	240	251,145	0.0
Eskom Holdings SOC Ltd.	6.75%	08/06/2023	2,633	2,619,835	0.4
Eskom Holdings SOC Ltd.	7.13%	02/11/2025	5,350	5,237,316	0.8
Eskom Holdings SOC Ltd.	8.45%	08/10/2028	2,935	2,920,875	0.5
Export-Import Bank of China (The)	4.00%	11/28/2047	5,917	6,669,879	1.0
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.80%	05/15/2050	1,375	1,389,008	0.2
KazMunayGas National Co. JSC	5.38%	04/24/2030	3,747	3,943,717	0.6
KazMunayGas National Co. JSC	5.75%	04/19/2047	1,546	1,584,650	0.2
KazMunayGas National Co., JSC	6.38%	10/24/2048	1,600	1,744,000	0.3
Lamar Funding Ltd.	3.96%	05/07/2025	4,303	4,219,091	0.7
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.38%	07/19/2022	4,396	1,318,800	0.2
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.63%	11/08/2026	1,322	330,500	0.1
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.50%	10/25/2027	4,482	4,650,075	0.7
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.63%	11/07/2024	2,935	3,067,075	0.5
Pertamina Persero PT	5.63%	05/20/2043	455	483,381	0.1

	Zinssatz	Datum	Anteile/Kontrakte	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Pertamina Persero PT	6.00%	05/03/2042	USD	3,625	\$ 4,008,570	0.6%
Pertamina Persero PT	6.45%	05/30/2044		1,854	2,175,576	0.3
Pertamina Persero PT	6.50%	05/27/2041		2,782	3,253,723	0.5
Petroleos de Venezuela SA(a)	5.38%	04/12/2027		7,377	276,649	0.0
Petroleos de Venezuela SA(a)	5.50%	04/12/2037		8,347	313,013	0.0
Petroleos de Venezuela SA(c)	9.00%	11/17/2021		9,326	349,728	0.1
Petroleos Mexicanos	6.50%	03/13/2027		4,652	4,775,278	0.7
Petroleos Mexicanos	6.70%	02/16/2032		1,233	1,183,680	0.2
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047		4,081	3,360,295	0.5
Petroleos Mexicanos	6.88%	08/04/2026		2,713	2,863,436	0.4
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060		9,016	7,443,610	1.1
Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050		3,499	3,131,605	0.5
Qatar Energy	3.30%	07/12/2051		7,282	6,863,285	1.1
Southern Gas Corridor CJSC	6.88%	03/24/2026		2,311	2,579,365	0.4
State Agency of Roads of Ukraine	6.25%	06/24/2028		2,984	895,200	0.1
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic	6.95%	03/18/2030		3,165	3,647,662	0.6
Transnet SOC Ltd.	4.00%	07/26/2022		2,256	2,233,440	0.3
Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027		2,327	2,338,635	0.4
					<u>109,157,163</u>	<u>16.8</u>
<b>SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE</b>						
Brazil Letras do Tesouro Nacional, Series LTN	0.00%	01/01/2024	BRL	28,065	4,423,907	0.7
Egypt Government Bond, Series 5YR	14.06%	01/12/2026	EGP	146,639	9,238,027	1.4
					<u>13,661,934</u>	<u>2.1</u>
<b>SCHATZOBIGATIONEN</b>						
U.S. Treasury Bonds	2.00%	11/15/2041	USD	5,150	4,919,055	0.8
<b>INVESTMENTGESELLSCHAFTEN</b>						
AB SICAV I - Emerging Market Corporate Debt Portfolio - Class S				120,265	3,083,584	0.5
<b>REGIONALANLEIHEN</b>						
Provincia de Neuquen Argentina	4.63%	04/27/2030	USD	2,798	1,594,777	0.2
<b>INFLATIONSGBUNDENE WERTPAPIERE</b>						
Fideicomiso PA Concesion Ruta al Mar	6.75%	02/15/2044	COP	3,129,329	544,472	0.1
					<u>585,826,390</u>	<u>90.1</u>
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>						
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>						
Digicel Group Holdings Ltd.(d)(e)	7.00%	03/15/2022	USD	215	176,627	0.0
Digicel Group Holdings Ltd.(e)	10.00%	04/01/2024		3,875	3,858,311	0.6
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058		3,385	13,543	0.0
Tonon Luxembourg SA(a)(e)(f)	6.50%	10/31/2024		1,523	0	0.0
USJ-Acucar e Alcool S/A(a)	9.88%	11/09/2023		4,432	2,304,552	0.4
Virgolino de Oliveira Finance SA(c)(f)	10.50%	01/28/2018		1,016	102	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(c)(f)	10.88%	01/13/2020		2,474	247	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(c)(f)	11.75%	02/09/2022		2,561	256	0.0
					<u>6,353,638</u>	<u>1.0</u>
<b>STAATSANLEIHEN</b>						
Ukraine Government International Bond	6.75%	06/20/2026	EUR	1,222	424,752	0.1
					<u>6,778,390</u>	<u>1.1</u>
<b>Gesamtanlagen</b>						
(Kosten \$736,836,695)					<u>\$ 592,604,780</u>	<u>91.2%</u>
<b>Termineinlagen</b>						
ANZ, London(g)	(0.21)%	–			52,489	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(g)	0.01 %	–			202	0.0
BBH, Grand Cayman(g)	0.25 %	–			349	0.0
BBH, Grand Cayman(g)	3.00 %	–			31,985	0.0
BNP Paribas, Paris(g)	0.08 %	–			292	0.0
SEB, Stockholm(g)	0.01 %	–			39,105,241	6.0
SEB, Stockholm(g)	0.10 %	–			185	0.0
Sumitomo, Tokyo(g)	(0.78)%	–			1,417	0.0
<b>Termineinlagen insgesamt</b>					<u>39,192,160</u>	<u>6.0</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b>					<u>18,286,395</u>	<u>2.8</u>
<b>Nettovermögen</b>					<u>\$ 650,083,335</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
<b>Long</b>					
U.S. 10 Yr Ultra Futures	06/21/2022	102	\$ 14,268,836	\$ 14,415,469	\$ 146,633
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	06/21/2022	134	24,550,438	24,915,625	365,187
					<u>\$ 511,820</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Bank of America, NA	USD 3,529	RUB 276,174	03/02/2022	\$ (972,153)
Bank of America, NA	INR 162,017	USD 2,152	04/07/2022	15,809
Barclays Bank PLC	RUB 820,565	USD 10,797	03/02/2022	3,198,517
Barclays Bank PLC	BRL 22,756	USD 4,428	03/03/2022	11,674
Barclays Bank PLC	USD 4,495	BRL 22,756	03/03/2022	(78,489)
Barclays Bank PLC	BRL 22,756	USD 4,455	04/04/2022	79,345
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 52	USD 8	03/04/2022	(31)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 105	CNH 665	03/04/2022	503
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 6,203	USD 6,995	03/14/2022	37,197
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 1,474	USD 1,638	03/14/2022	(14,568)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 116,422	EUR 102,212	03/14/2022	(1,759,371)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 6,745	USD 4,842	03/18/2022	(58,533)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 110	USD 86	03/18/2022	(659)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 1	USD 1	03/18/2022	(14)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 7	USD 10	03/18/2022	101
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 17	USD 23	03/18/2022	(95)
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 407	USD 272	03/18/2022	(3,179)
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 2,306	USD 560	03/18/2022	11,820
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 522	USD 123	03/18/2022	(1,151)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 446	USD 330	03/18/2022	1,047
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 119	USD 88	03/18/2022	(278)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 69,066	AUD 96,330	03/18/2022	915,467
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,189	CAD 1,510	03/18/2022	1,716
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 20	CNH 19	03/18/2022	139
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 461	GBP 340	03/18/2022	(5,346)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,496	NZD 5,252	03/18/2022	56,948
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 9,536	PLN 37,804	03/18/2022	(541,740)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 5,768	SGD 7,751	03/18/2022	(50,907)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 39,011	ZAR 590,867	03/18/2022	(665,752)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 26,372	USD 1,731	03/18/2022	19,534
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 11,536	USD 744	03/18/2022	(4,727)
Citibank, NA	ZAR 4,480	USD 293	04/21/2022	3,910
Deutsche Bank AG	USD 9,702	RUB 799,464	03/02/2022	(2,299,617)
Deutsche Bank AG	RUB 799,464	USD 9,554	03/24/2022	2,152,815
Goldman Sachs Bank USA	BRL 22,756	USD 4,400	03/03/2022	(16,363)
Goldman Sachs Bank USA	USD 4,428	BRL 22,756	03/03/2022	(11,674)
Morgan Stanley & Co. LLC	COP 3,528,784	USD 888	03/25/2022	(6,128)
Morgan Stanley & Co. LLC	EUR 4,727	USD 5,410	05/12/2022	95,148
UBS AG	RUB 255,073	USD 3,379	03/02/2022	1,016,925
UBS AG	USD 1,003	EUR 889	05/12/2022	(2,883)
				<u>\$ 1,124,957</u>
			Wertsteigerung	\$ 7,618,615
			Wertminderung	\$ (6,493,658)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschlussdatum	Nominalbetrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
<b>Kaufkontrakte</b>					
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Russian Federation	05/11/2063	USD 5,030	\$ 2,362,356	\$ 2,224,819
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-EM Series 36, 5 Year Index	05/11/2063	29,350	2,333,325	1,405,953
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Colombia	05/11/2063	4,500	246,353	45,844
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Turkey	05/11/2063	760	145,072	4,658
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of South Africa	05/11/2063	2,450	138,246	36,325
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Indonesia	05/11/2063	5,140	35,785	89,787
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	People's Republic of China	05/11/2063	5,230	(80,231)	59,706
Insgesamt				<u>\$ 5,180,906</u>	<u>\$ 3,867,092</u>

- (a) Not leidend.
- (b) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 28. Februar 2022.
- (c) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (d) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (e) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (f) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (g) Tagesgeld.

**Währungskürzel:**

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

**Glossar:**

- CBT – Chicago Board of Trade
- CDX-EM – Emerging Market Credit Default Swap Index
- CJSC – Closed Joint Stock Company
- INTRCONX – Inter-Continental Exchange
- JSC – Joint Stock Company
- PJSC – Public Joint Stock Company

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE</b>					
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2020-3A, Class M2(a)	5.04%	10/25/2030	USD 4,000	\$ 4,150,594	0.4%
Series 2021-1A, Class M1C(a)	3.00%	03/25/2031	3,000	2,983,665	0.3
Series 2021-1A, Class M2(a)	4.90%	03/25/2031	1,000	1,033,893	0.1
Series 2022-1, Class M1C(a)	3.75%	01/26/2032	3,000	2,975,461	0.3
Series 2022-1, Class M2(a)	4.65%	01/26/2032	500	489,401	0.0
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2018-R07, Class 1B1(a)	4.54%	04/25/2031	2,000	2,039,815	0.2
Series 2019-R04, Class 2B1(a)	5.44%	06/25/2039	7,000	7,061,313	0.6
Series 2019-R06, Class 2B1(a)	3.94%	09/25/2039	3,500	3,441,267	0.3
Series 2020-R02, Class 2B1(a)	3.19%	01/25/2040	4,000	3,794,949	0.3
Series 2020-SBT1, Class 1B1(a)	6.94%	02/25/2040	1,000	999,997	0.1
Series 2020-SBT1, Class 1M2(a)	3.84%	02/25/2040	3,250	3,346,993	0.3
Series 2020-SBT1, Class 2B1(a)	6.79%	02/25/2040	1,000	999,997	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2M2(a)	3.84%	02/25/2040	2,840	2,977,581	0.3
Series 2021-R01, Class 1B2(a)	6.05%	10/25/2041	500	460,603	0.0
Series 2022-R01, Class 1B2(a)	6.05%	12/25/2041	2,500	2,280,376	0.2
Series 2022-R01, Class 1M2(a)	1.95%	12/25/2041	12,215	11,881,948	1.1
Series 2022-R02, Class 2B1(a)	4.55%	01/25/2042	2,000	1,933,373	0.2
Series 2022-R02, Class 2B2(a)	7.70%	01/25/2042	1,000	970,955	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Series 2018-HQA2, Class B1(a)	4.44%	10/25/2048	5,750	5,952,705	0.5
Series 2018-HQA2, Class B2(a)	11.19%	10/25/2048	7,550	8,452,414	0.8
Series 2019-DNA1, Class B2(a)	10.94%	01/25/2049	3,750	4,050,361	0.4
Series 2019-DNA2, Class B2(a)	10.69%	03/25/2049	925	986,227	0.1
Series 2019-DNA3, Class B1(a)	3.44%	07/25/2049	2,000	1,984,679	0.2
Series 2019-DNA4, Class B2(a)	6.44%	10/25/2049	3,850	3,802,990	0.3
Series 2019-HQA1, Class B1(a)	4.59%	02/25/2049	2,000	2,018,186	0.2
Series 2019-HQA2, Class B2(a)	11.44%	04/25/2049	4,400	4,747,950	0.4
Series 2019-HQA3, Class B2(a)	7.69%	09/25/2049	6,150	6,180,006	0.6
Series 2020-DNA1, Class B2(a)	5.44%	01/25/2050	7,500	7,238,084	0.7
Series 2020-DNA2, Class B2(a)	4.99%	02/25/2050	8,651	8,018,025	0.7
Series 2020-DNA5, Class B1(a)	4.85%	10/25/2050	3,600	3,738,817	0.3
Series 2020-DNA5, Class B2(a)	11.55%	10/25/2050	3,000	3,678,415	0.3
Series 2020-HQA1, Class B2(a)	5.29%	01/25/2050	6,000	5,645,305	0.5
Series 2020-HQA2, Class B2(a)	7.79%	03/25/2050	6,000	6,052,477	0.6
Series 2020-HQA3, Class M2(a)	3.79%	07/25/2050	4	4,307	0.0
Series 2021-DNA1, Class B1(a)	2.70%	01/25/2051	4,400	4,137,716	0.4
Series 2021-DNA1, Class B2(a)	4.80%	01/25/2051	2,000	1,796,487	0.2
Series 2021-DNA3, Class B1(a)	3.55%	10/25/2033	4,000	3,893,919	0.4
Series 2021-DNA3, Class B2(a)	6.30%	10/25/2033	1,000	961,786	0.1
Series 2021-DNA5, Class B1(a)	3.10%	01/25/2034	2,000	1,904,693	0.2
Series 2021-DNA5, Class B2(a)	5.55%	01/25/2034	3,000	2,632,766	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit					
Risk Debt Notes					
Series 2015-DNA1, Class B(a)	9.39%	10/25/2027	7,246	8,152,289	0.7
Series 2015-DNA1, Class M3(a)	3.49%	10/25/2027	2,170	2,203,156	0.2
Series 2015-DNA2, Class B(a)	7.74%	12/25/2027	7,381	7,720,205	0.7
Series 2015-DNA2, Class M3(a)	4.09%	12/25/2027	96	96,510	0.0
Series 2015-DNA3, Class B(a)	9.54%	04/25/2028	6,437	7,044,963	0.6
Series 2015-HQ1, Class B(a)	10.94%	03/25/2025	2,653	2,699,063	0.2
Series 2015-HQ2, Class B(a)	8.14%	05/25/2025	2,847	2,884,045	0.3
Series 2015-HQA1, Class B(a)	8.99%	03/25/2028	3,458	3,632,000	0.3
Series 2015-HQA2, Class B(a)	10.69%	05/25/2028	3,603	4,007,498	0.4
Series 2016-DNA1, Class B(a)	10.19%	07/25/2028	1,917	2,120,427	0.2
Series 2016-DNA2, Class B(a)	10.69%	10/25/2028	6,759	7,723,996	0.7
Series 2016-DNA3, Class B(a)	11.44%	12/25/2028	1,482	1,719,474	0.2
Series 2016-DNA4, Class B(a)	8.79%	03/25/2029	990	1,042,651	0.1
Series 2016-HQA1, Class B(a)	12.94%	09/25/2028	2,488	3,004,681	0.3
Series 2016-HQA2, Class B(a)	11.69%	11/25/2028	498	581,593	0.1
Series 2016-HQA2, Class M3B(a)	5.34%	11/25/2028	1,220	1,275,673	0.1
Series 2017-HQA2, Class B1(a)	4.94%	12/25/2029	4,165	4,392,815	0.4
Series 2017-HQA2, Class M2B(a)	2.84%	12/25/2029	3,263	3,322,298	0.3
Series 2017-HQA3, Class B1(a)	4.64%	04/25/2030	4,250	4,419,257	0.4
Series 2018-SPI1, Class B(b)	3.73%	02/25/2048	1,250	1,181,857	0.1
Series 2018-SPI2, Class B(b)	3.80%	05/25/2048	1,580	1,499,093	0.1
Series 2018-SPI3, Class B(b)	4.15%	08/25/2048	732	704,426	0.1
Series 2018-SPI4, Class B(b)	4.51%	11/25/2048	1,915	1,828,250	0.2
Series 2021-DNA2, Class B1(a)	3.45%	08/25/2033	2,000	1,934,461	0.2
Series 2021-DNA2, Class B2(a)	6.05%	08/25/2033	1,250	1,171,923	0.1
Series 2021-DNA2, Class M2(a)	2.35%	08/25/2033	2,000	2,011,830	0.2
Series 2021-DNA6, Class B1(a)	3.45%	10/25/2041	1,000	952,121	0.1

**AB FCP I**  
**Mortgage Income Portfolio**

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2021-DNA6, Class B2(a) . . . . .	7.55%	10/25/2041	USD 1,500	\$ 1,429,051	0.1%
Series 2021-DNA6, Class M2(a) . . . . .	1.55%	10/25/2041	4,700	4,533,507	0.4
Series 2021-DNA7, Class B1(a) . . . . .	3.70%	11/25/2041	2,000	1,918,649	0.2
Series 2021-DNA7, Class B2(a) . . . . .	7.85%	11/25/2041	1,000	956,193	0.1
Series 2021-DNA7, Class M2(a) . . . . .	1.85%	11/25/2041	4,650	4,475,625	0.4
Series 2021-HQA3, Class B1(a) . . . . .	3.40%	09/25/2041	2,000	1,856,487	0.2
Series 2021-HQA4, Class B1(a) . . . . .	3.80%	12/25/2041	2,000	1,875,520	0.2
Series 2022-DNA1, Class B1(a) . . . . .	3.45%	01/25/2042	1,000	940,615	0.1
Series 2022-DNA1, Class B2(a) . . . . .	7.15%	01/25/2042	1,500	1,373,588	0.1
Series 2022-DNA1, Class M1B(a) . . . . .	1.90%	01/25/2042	7,812	7,692,858	0.7
Series 2022-DNA2, Class B1(a) . . . . .	4.80%	02/25/2042	1,000	989,778	0.1
Series 2022-DNA2, Class B2(a) . . . . .	8.55%	02/25/2042	500	487,920	0.0
Series 2022-DNA2, Class M1B(a) . . . . .	2.45%	02/25/2042	5,000	4,970,283	0.5
<b>Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities</b>					
Series 2013-C01, Class M2(a) . . . . .	5.44%	10/25/2023	539	561,191	0.1
Series 2014-C04, Class 1M2(a) . . . . .	5.09%	11/25/2024	533	552,414	0.1
Series 2015-C04, Class 1M2(a) . . . . .	5.89%	04/25/2028	5,559	5,864,579	0.5
Series 2015-C04, Class 2M2(a) . . . . .	5.74%	04/25/2028	2,824	2,984,866	0.3
Series 2016-C01, Class 1B(a) . . . . .	11.94%	08/25/2028	2,688	2,975,188	0.3
Series 2016-C01, Class 2M2(a) . . . . .	7.14%	08/25/2028	759	801,026	0.1
Series 2016-C02, Class 1B(a) . . . . .	12.44%	09/25/2028	6,068	6,894,556	0.6
Series 2016-C02, Class 1M2(a) . . . . .	6.19%	09/25/2028	903	935,660	0.1
Series 2016-C03, Class 1B(a) . . . . .	11.94%	10/25/2028	3,478	3,929,235	0.4
Series 2016-C03, Class 2B(a) . . . . .	12.94%	10/25/2028	3,224	3,773,793	0.3
Series 2016-C04, Class 1B(a) . . . . .	10.44%	01/25/2029	3,217	3,521,161	0.3
Series 2016-C05, Class 2B(a) . . . . .	11.24%	01/25/2029	4,920	5,298,432	0.5
Series 2016-C06, Class 1B(a) . . . . .	9.44%	04/25/2029	5,045	5,470,591	0.5
Series 2016-C07, Class 2B(a) . . . . .	9.69%	05/25/2029	3,559	3,828,614	0.3
Series 2017-C02, Class 2B1(a) . . . . .	5.69%	09/25/2029	6,313	6,802,353	0.6
Series 2017-C03, Class 1M2(a) . . . . .	3.19%	10/25/2029	749	764,905	0.1
Series 2017-C03, Class 1M2C(a) . . . . .	3.19%	10/25/2029	2,555	2,620,261	0.2
Series 2017-C04, Class 2B1(a) . . . . .	5.24%	11/25/2029	2,000	2,139,126	0.2
Series 2017-C04, Class 2M2(a) . . . . .	3.04%	11/25/2029	315	321,135	0.0
Series 2017-C07, Class 1M2C(a) . . . . .	2.59%	05/25/2030	5,894	5,977,992	0.5
Series 2017-C07, Class 2B1(a) . . . . .	4.64%	05/25/2030	2,736	2,778,116	0.2
Series 2018-C02, Class 2B1(a) . . . . .	4.19%	08/25/2030	3,750	3,785,162	0.3
Series 2018-C04, Class 2B1(a) . . . . .	4.69%	12/25/2030	3,500	3,552,488	0.3
Series 2018-C05, Class 1B1(a) . . . . .	4.44%	01/25/2031	4,000	4,056,241	0.4
Series 2021-R02, Class 2B1(a) . . . . .	3.35%	11/25/2041	3,000	2,813,168	0.3
Series 2021-R02, Class 2B2(a) . . . . .	6.25%	11/25/2041	1,000	934,839	0.1
<b>Home Re Ltd.</b>					
Series 2020-1, Class M2(a) . . . . .	5.44%	10/25/2030	1,000	1,029,506	0.1
Series 2021-1, Class M2(a) . . . . .	3.04%	07/25/2033	4,000	3,876,212	0.4
Oaktown Re V Ltd., Series 2020-2A, Class M2(a) . . . . .	5.44%	10/25/2030	3,500	3,495,812	0.3
<b>PMT Credit Risk Transfer Trust</b>					
Series 2019-1R, Class A(a) . . . . .	2.11%	03/27/2024	1,863	1,863,153	0.2
Series 2019-2R, Class A(a) . . . . .	2.86%	05/27/2023	5,856	5,820,566	0.5
Series 2019-3R, Class A(a) . . . . .	2.81%	10/27/2022	1,277	1,275,519	0.1
<b>Radnor Re Ltd.</b>					
Series 2020-1, Class M2A(a) . . . . .	2.19%	01/25/2030	1,000	962,184	0.1
Series 2021-2, Class M2(a) . . . . .	5.05%	11/25/2031	4,000	4,056,116	0.4
<b>STACR Trust</b>					
Series 2018-DNA3, Class B1(a) . . . . .	4.09%	09/25/2048	2,550	2,541,112	0.2
Series 2018-DNA3, Class B2(a) . . . . .	7.94%	09/25/2048	6,015	6,256,301	0.6
<b>Traingle Re Ltd.</b>					
Series 2020-1, Class M2(a) . . . . .	5.79%	10/25/2030	3,000	3,056,154	0.3
Series 2021-1, Class M2(a) . . . . .	4.09%	08/25/2033	5,000	5,035,488	0.5
<b>Triangle Re Ltd.</b>					
Series 2021-3, Class M1B(a) . . . . .	2.95%	02/25/2034	4,500	4,480,301	0.4
Series 2021-3, Class M2(a) . . . . .	3.80%	02/25/2034	4,500	4,308,230	0.4
				386,520,871	35.5
<b>NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH</b>					
<b>Alternative Loan Trust</b>					
Series 2005-50CB, Class 1A1 . . . . .	5.50%	11/25/2035	993	925,126	0.1
Series 2006-11CB, Class 1A2 . . . . .	6.00%	05/25/2036	868	645,345	0.1
Series 2006-28CB, Class A14 . . . . .	6.25%	10/25/2036	416	289,018	0.0
Series 2006-28CB, Class A18 . . . . .	6.00%	10/25/2036	704	475,120	0.0
Angel Oak Mortgage Trust, Series 2021-2, Class A1 . . . . .	0.99%	04/25/2066	4,284	4,193,105	0.4
BCAP LLC Trust, Series 2008-IND2, Class A2 . . . . .	3.01%	04/25/2038	846	779,378	0.1
<b>Brean Asset Backed Securities Trust</b>					
Series 2021-RM2, Class A . . . . .	1.75%	10/25/2061	5,954	5,642,648	0.5
Series 2021-RM2, Class M2 . . . . .	1.75%	10/25/2061	1,511	1,293,215	0.1
Series 2022-RM3, Class M2 . . . . .	1.75%	02/25/2062	2,450	1,979,600	0.2
Chase Mortgage Finance Trust, Series 2007-S5, Class 1A17 . . . . .	6.00%	07/25/2037	1,711	1,070,262	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2006-10, Class 1A8 . . .	6.00%	05/25/2036	USD 1,226	\$ 766,604	0.1%
CitiMortgage Alternative Loan Trust, Series 2007-A6, Class 1A11 . . . . .	6.00%	06/25/2037	114	114,027	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust Series 2005-FA8, Class 1A12 . . . . .	5.50%	11/25/2035	98	65,399	0.0
Series 2006-FA2, Class 1A3 . . . . .	6.00%	05/25/2036	186	113,700	0.0
Flagstar Mortgage Trust, Series 2017-1, Class B3 . . . . .	3.66%	03/25/2047	1,654	1,646,258	0.2
JPMorgan Mortgage Trust Series 2017-2, Class B3 . . . . .	3.66%	05/25/2047	1,755	1,750,267	0.2
Series 2017-4, Class B3 . . . . .	3.89%	11/25/2048	2,025	2,008,513	0.2
Series 2017-6, Class B3 . . . . .	3.79%	12/25/2048	1,367	1,358,673	0.1
Series 2018-3, Class B2 . . . . .	3.73%	09/25/2048	2,604	2,587,236	0.2
Series 2018-6, Class B2 . . . . .	3.91%	12/25/2048	1,637	1,607,852	0.1
Series 2018-9, Class B2 . . . . .	4.28%	02/25/2049	2,451	2,421,448	0.2
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, Series 2006-7, Class 4A4 . . . . .	6.00%	06/25/2036	474	339,337	0.0
Shellpoint Co-Originator Trust, Series 2017-1, Class B3 . . . . .	3.62%	04/25/2047	1,963	1,956,693	0.2
				<u>34,028,824</u>	<u>3.1</u>
<b>FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE</b>					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs, Series 5080, Class IJ(c) . . . . .	4.00%	12/25/2050	7,759	1,195,802	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs Series 5011, Class MI(c) . . . . .	3.00%	09/25/2050	7,075	1,118,353	0.1
Series 5015, Class BI(c) . . . . .	4.00%	09/25/2050	12,334	2,045,392	0.2
Series 5015, Class DI(c) . . . . .	4.00%	09/25/2050	7,917	1,367,270	0.1
Series 5030, Class EI(c) . . . . .	3.50%	10/25/2050	13,145	2,499,099	0.2
Series 5040, Class AI(c) . . . . .	3.50%	11/25/2050	2,978	493,766	0.1
Series 5040, Class CI(c) . . . . .	4.00%	11/25/2050	10,795	1,614,548	0.2
Series 5049, Class CI(c) . . . . .	3.50%	12/25/2050	15,464	2,231,271	0.2
Federal National Mortgage Association REMICs Series 2015-30, Class EI(c) . . . . .	5.00%	05/25/2045	571	95,251	0.0
Series 2016-64, Class BI(c) . . . . .	5.00%	09/25/2046	5,206	795,618	0.1
Series 2020-78, Class IO(c) . . . . .	2.50%	11/25/2050	7,291	963,951	0.1
Series 2020-89, Class KI(c) . . . . .	4.00%	12/25/2050	13,184	2,026,823	0.2
Series 2021-18, Class IT(c) . . . . .	3.00%	04/25/2051	8,696	1,182,971	0.1
Government National Mortgage Association Series 2021-117, Class MI(c) . . . . .	3.50%	05/20/2042	16,650	2,221,325	0.2
Series 2021-131, Class IO(c) . . . . .	3.00%	07/20/2051	10,985	1,337,599	0.1
				<u>21,189,039</u>	<u>2.0</u>
<b>VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE</b>					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs Series 3928, Class SE(a)(d) . . . . .	6.39%	09/15/2041	4,211	831,030	0.1
Series 4372, Class JS(a)(d) . . . . .	5.91%	08/15/2044	7,232	1,241,055	0.1
Series 4416, Class BS(a)(d) . . . . .	5.91%	12/15/2044	1,815	293,773	0.0
Series 4719, Class JS(a)(d) . . . . .	5.96%	09/15/2047	3,379	533,080	0.0
Series 4767, Class SB(a)(d) . . . . .	6.01%	03/15/2048	3,754	599,066	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs Series 2011-131, Class ST(a)(d) . . . . .	6.35%	12/25/2041	4,590	846,063	0.1
Series 2012-122, Class MS(a)(d) . . . . .	5.91%	11/25/2042	1,826	385,408	0.0
Series 2013-15, Class SA(a)(d) . . . . .	5.96%	03/25/2043	4,254	823,421	0.1
Series 2014-40, Class HS(a)(d) . . . . .	6.51%	07/25/2044	2,586	640,315	0.1
Series 2015-90, Class SL(a)(d) . . . . .	5.96%	12/25/2045	4,974	929,751	0.1
Series 2016-106, Class ES(a)(d) . . . . .	5.81%	01/25/2047	1,694	288,825	0.0
Series 2016-69, Class DS(a)(d) . . . . .	5.91%	10/25/2046	8,472	1,247,395	0.1
Series 2017-20, Class SJ(a)(d) . . . . .	5.91%	04/25/2047	4,335	764,721	0.1
Series 2017-97, Class LS(a)(d) . . . . .	6.01%	12/25/2047	5,546	1,046,849	0.1
Series 2017-97, Class SW(a)(d) . . . . .	6.01%	12/25/2047	5,390	1,054,186	0.1
Series 2018-28, Class SB(a)(d) . . . . .	6.01%	05/25/2048	4,518	786,361	0.1
Series 2018-30, Class SA(a)(d) . . . . .	6.01%	05/25/2048	3,685	566,154	0.1
Series 2018-58, Class SA(a)(d) . . . . .	6.01%	08/25/2048	2,145	390,069	0.0
Government National Mortgage Association Series 2014-181, Class TV(a)(d) . . . . .	6.12%	02/16/2035	3,838	415,939	0.0
Series 2015-3, Class DS(a)(d) . . . . .	5.44%	11/20/2041	3,382	184,851	0.0
Series 2019-61, Class NS(a)(d) . . . . .	5.94%	02/20/2049	13,473	1,981,136	0.2
Series 2020-31, Class KS(a)(d) . . . . .	5.94%	03/20/2050	10,249	1,925,240	0.1
				<u>17,774,688</u>	<u>1.6</u>
<b>NICHT STAATLICH VARIABLE VERZINSLICH</b>					
Alternative Loan Trust, Series 2005-19CB, Class A2(a)(d) . . . . .	16.53%	06/25/2035	73	73,881	0.0
Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust Series 2005-AC7, Class A2(a)(d) . . . . .	18.13%	10/25/2035	251	236,341	0.0
Series 2005-AC9, Class A4(a)(d) . . . . .	18.02%	12/25/2035	271	196,679	0.0
Chase Mortgage Finance Corp. Series 2016-SH1, Class M4(b) . . . . .	3.75%	04/25/2045	1,369	1,342,771	0.1
Series 2016-SH2, Class M4(b) . . . . .	3.73%	12/25/2045	577	571,771	0.1



	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates,					
Series 2005-9, Class 4A1(a)(d) . . . . .	19.01%	10/25/2035	USD 66	\$ 75,409	0.0%
Lehman Mortgage Trust, Series 2007-1, Class 3A2(a)(d) . . . . .	7.06%	02/25/2037	888	167,951	0.0
RALI Trust, Series 2006-QO3, Class A1(a) . . . . .	0.61%	04/25/2046	2,421	869,244	0.1
Sequoia Mortgage Trust, Series 2018-7, Class B2(b) . . . . .	4.26%	09/25/2048	2,381	2,357,634	0.2
Structured Asset Securities Corp Trust,					
Series 2006-11, Class A3(a) . . . . .	0.25%	10/28/2035	7,061	4,814,484	0.5
				<u>10,706,165</u>	<u>1.0</u>
				<u>470,219,587</u>	<u>43.2</u>
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>					
<b>NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS</b>					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E . . . . .	4.65%	02/10/2036	2,000	1,958,959	0.2
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2013-WBRK, Class D . . . . .	3.53%	03/10/2037	3,000	2,802,009	0.3
Banc of America Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-UBS7, Class AS . . . . .	3.99%	09/15/2048	1,140	1,176,433	0.1
Series 2015-UBS7, Class XA(c) . . . . .	0.79%	09/15/2048	74,036	1,813,124	0.2
BANK					
Series 2017-BNK5, Class AS . . . . .	3.62%	06/15/2060	2,500	2,558,820	0.2
Series 2017-BNK6, Class AS . . . . .	3.74%	07/15/2060	2,500	2,568,394	0.2
Series 2018-BN13, Class AS . . . . .	4.47%	08/15/2061	5,000	5,377,163	0.5
Series 2018-BN14, Class XA(c) . . . . .	0.49%	09/15/2060	86,719	2,236,799	0.2
BBCMS Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class AS . . . . .	3.90%	02/15/2050	2,500	2,574,813	0.2
Benchmark Mortgage Trust, Series 2018-B2, Class AS . . . . .	4.08%	02/15/2051	2,500	2,617,229	0.2
CCUBS Commercial Mortgage Trust,					
Series 2017-C1, Class XA(c) . . . . .	0.99%	11/15/2050	15,479	574,129	0.1
CD Mortgage Trust, Series 2017-CD3, Class XA(c) . . . . .	0.98%	02/10/2050	94,978	3,848,106	0.4
CFCRE Commercial Mortgage Trust					
Series 2016-C4, Class AM . . . . .	3.69%	05/10/2058	190	194,326	0.0
Series 2016-C7, Class A3 . . . . .	3.84%	12/10/2054	2,500	2,610,064	0.2
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2013-GC11, Class D . . . . .	4.42%	04/10/2046	1,056	1,055,285	0.1
Series 2013-GC17, Class D . . . . .	5.10%	11/10/2046	2,430	2,259,510	0.2
Series 2015-GC29, Class XA(c) . . . . .	1.02%	04/10/2048	6,446	172,040	0.0
Series 2016-C3, Class XA(c) . . . . .	1.03%	11/15/2049	87,861	3,534,279	0.3
Series 2016-P3, Class XA(c) . . . . .	1.66%	04/15/2049	40,639	1,989,630	0.2
Series 2016-P6, Class AS . . . . .	4.03%	12/10/2049	3,310	3,430,163	0.3
Series 2017-C4, Class XA(c) . . . . .	1.08%	10/12/2050	57,147	2,382,251	0.2
Series 2017-P8, Class XA(c) . . . . .	0.89%	09/15/2050	43,522	1,774,865	0.2
Series 2018-C6, Class XA(c) . . . . .	0.77%	11/10/2051	7,898	355,011	0.0
Commercial Mortgage Trust					
Series 2010-C1, Class D . . . . .	5.79%	07/10/2046	2,500	2,503,657	0.2
Series 2010-C1, Class F . . . . .	4.00%	07/10/2046	3,780	3,125,753	0.3
Series 2012-CR2, Class G . . . . .	4.25%	08/15/2045	1,500	827,850	0.1
Series 2012-CR3, Class E . . . . .	4.75%	10/15/2045	2,173	1,283,501	0.1
Series 2012-CR3, Class XA(c) . . . . .	1.83%	10/15/2045	2,782	9,653	0.0
Series 2012-CR5, Class XA(c) . . . . .	1.49%	12/10/2045	14,016	88,237	0.0
Series 2013-LC6, Class D . . . . .	4.29%	01/10/2046	640	629,847	0.1
Series 2013-LC6, Class XA(c) . . . . .	1.26%	01/10/2046	12,142	63,250	0.0
Series 2014-CR16, Class D . . . . .	4.92%	04/10/2047	1,841	1,726,832	0.2
Series 2014-CR19, Class XA(c) . . . . .	0.95%	08/10/2047	71,894	1,372,730	0.1
Series 2014-CR20, Class XA(c) . . . . .	0.98%	11/10/2047	7,711	162,562	0.0
Series 2014-LC17, Class B . . . . .	4.49%	10/10/2047	2,000	2,041,207	0.2
Series 2014-UBS2, Class D . . . . .	5.00%	03/10/2047	1,250	1,218,769	0.1
Series 2014-UBS6, Class AM . . . . .	4.05%	12/10/2047	190	195,832	0.0
Series 2015-CR22, Class XA(c) . . . . .	0.88%	03/10/2048	13,976	311,051	0.0
Series 2015-CR27, Class XA(c) . . . . .	0.91%	10/10/2048	91,294	2,596,738	0.2
Series 2015-LC19, Class XA(c) . . . . .	1.11%	02/10/2048	49,010	1,282,375	0.1
Series 2015-LC21, Class XA(c) . . . . .	0.67%	07/10/2048	50,673	954,453	0.1
Series 2016-DC2, Class XA(c) . . . . .	0.95%	02/10/2049	47,885	1,484,705	0.1
CSAIL Commercial Mortgage Trust,					
Series 2017-C8, Class XA(c) . . . . .	1.19%	06/15/2050	53,353	2,584,307	0.2
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class C . . . . .	5.16%	08/10/2044	4,850	4,007,991	0.4
Series 2011-GC5, Class D . . . . .	5.16%	08/10/2044	493	227,815	0.0
Series 2013-GC12, Class C . . . . .	4.18%	06/10/2046	5,540	5,586,868	0.5
Series 2013-GC13, Class C . . . . .	4.06%	07/10/2046	4,537	4,212,874	0.4
Series 2013-GC13, Class D . . . . .	4.06%	07/10/2046	2,190	915,694	0.1
Series 2014-GC18, Class D . . . . .	5.05%	01/10/2047	618	271,933	0.0
Series 2014-GC22, Class A5 . . . . .	3.86%	06/10/2047	2,500	2,572,238	0.2
Series 2014-GC22, Class XA(c) . . . . .	0.94%	06/10/2047	6,532	97,622	0.0
Series 2016-GS3, Class A4 . . . . .	2.85%	10/10/2049	2,500	2,521,591	0.2
Series 2016-GS3, Class XA(c) . . . . .	1.20%	10/10/2049	74,763	3,319,666	0.3
Series 2017-GS5, Class XA(c) . . . . .	0.84%	03/10/2050	52,574	1,954,831	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2017-GS6, Class AS	3.64%	05/10/2050	USD 2,000	\$ 2,057,352	0.2%
Series 2017-GS7, Class XA(c)	1.11%	08/10/2050	26,727	1,196,459	0.1
Series 2017-GS8, Class XA(c)	0.96%	11/10/2050	38,210	1,542,350	0.2
<b>JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b>					
Series 2012-C6, Class E	5.22%	05/15/2045	2,250	1,566,078	0.2
Series 2012-C8, Class C	4.62%	10/15/2045	3,000	2,999,146	0.3
Series 2013-C10, Class B	3.67%	12/15/2047	2,213	2,228,606	0.2
Series 2016-JP2, Class XA(c)	1.78%	08/15/2049	40,714	2,613,931	0.2
<b>JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust</b>					
Series 2013-C14, Class D	4.55%	08/15/2046	3,425	2,197,957	0.2
Series 2013-C17, Class D	4.89%	01/15/2047	2,535	2,431,745	0.2
Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047	2,000	2,029,160	0.2
Series 2014-C22, Class XA(c)	0.82%	09/15/2047	96,211	1,586,495	0.2
Series 2014-C24, Class C	4.38%	11/15/2047	6,000	5,636,685	0.5
<b>JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b>					
Series 2011-C4, Class C	5.39%	07/15/2046	1,673	1,706,751	0.2
Series 2011-C5, Class D	5.73%	08/15/2046	108	107,533	0.0
Series 2012-C6, Class G	2.97%	05/15/2045	2,500	1,115,368	0.1
Series 2012-C8, Class B	3.98%	10/15/2045	5,000	5,013,483	0.5
Series 2012-C8, Class E	4.67%	10/15/2045	1,645	1,526,105	0.1
Series 2012-CBX, Class C	4.78%	06/15/2045	3,000	2,915,818	0.3
Series 2013-C10, Class D	4.10%	12/15/2047	1,550	1,531,630	0.1
Series 2014-C20, Class XA(c)	0.86%	07/15/2047	10,859	130,297	0.0
Series 2016-JP3, Class B	3.40%	08/15/2049	2,000	1,987,207	0.2
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(c)	1.51%	07/12/2050	27,589	1,718,299	0.2
<b>Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust</b>					
Series 2012-C5, Class XA(c)	1.32%	08/15/2045	14,189	18,613	0.0
Series 2012-C6, Class E	4.60%	11/15/2045	425	404,675	0.0
Series 2012-C6, Class XA(c)	1.59%	11/15/2045	3,372	6,401	0.0
Series 2014-C18, Class C	4.50%	10/15/2047	1,333	1,323,930	0.1
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	1,225	1,147,606	0.1
Series 2014-C19, Class XA(c)	0.96%	12/15/2047	27,072	567,797	0.1
Series 2015-C20, Class XA(c)	1.26%	02/15/2048	58,099	1,587,875	0.2
Series 2015-C22, Class XA(c)	1.02%	04/15/2048	47,110	1,110,616	0.1
Series 2015-C25, Class XA(c)	1.05%	10/15/2048	30,314	866,187	0.1
Series 2017-C34, Class XA(c)	0.78%	11/15/2052	30,803	1,072,384	0.1
<b>Morgan Stanley Capital I Trust</b>					
Series 2011-C3, Class C	5.09%	07/15/2049	556	563,309	0.1
Series 2016-UBS9, Class XA(c)	1.16%	03/15/2049	59,584	2,076,378	0.2
Series 2018-L1, Class XA(c)	0.51%	10/15/2051	158,976	4,425,417	0.4
<b>UBS Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2012-C1, Class D	5.82%	05/10/2045	2,576	2,412,355	0.2
Series 2017-C3, Class XA(c)	1.07%	08/15/2050	36,952	1,560,089	0.2
Series 2017-C4, Class XA(c)	1.01%	10/15/2050	19,647	917,529	0.1
Series 2017-C5, Class XA(c)	0.98%	11/15/2050	38,627	1,480,914	0.1
Series 2018-C10, Class XA(c)	0.93%	05/15/2051	76,676	3,541,570	0.3
Series 2018-C14, Class XA(c)	0.98%	12/15/2051	51,297	2,795,175	0.3
Series 2018-C15, Class XA(c)	0.90%	12/15/2051	28,491	1,380,676	0.1
<b>UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2012-C4, Class C	4.31%	12/10/2045	7,000	6,923,808	0.6
Series 2012-C4, Class XA(c)	1.57%	12/10/2045	12,623	61,519	0.0
Series 2013-C5, Class XA(c)	0.88%	03/10/2046	29,722	124,410	0.0
Series 2013-C6, Class D	4.30%	04/10/2046	3,618	3,090,384	0.3
Series 2013-C6, Class XA(c)	1.09%	04/10/2046	3,225	20,969	0.0
<b>Wells Fargo Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2012-LC5, Class D	4.74%	10/15/2045	380	380,834	0.0
Series 2015-C27, Class XA(c)	0.86%	02/15/2048	129,388	2,777,909	0.3
Series 2015-C29, Class C	4.22%	06/15/2048	3,852	3,908,897	0.4
Series 2015-C31, Class A3	3.43%	11/15/2048	1,225	1,241,256	0.1
Series 2015-NXS3, Class A4	3.62%	09/15/2057	1,425	1,469,293	0.1
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	1,313	1,351,779	0.1
Series 2016-C32, Class XA(c)	1.21%	01/15/2059	56,675	2,252,919	0.2
Series 2016-C33, Class XA(c)	1.61%	03/15/2059	36,427	1,970,848	0.2
Series 2016-C35, Class A3	2.67%	07/15/2048	2,497	2,480,252	0.2
Series 2016-C35, Class B	3.44%	07/15/2048	2,500	2,461,065	0.2
Series 2016-C35, Class XA(c)	1.89%	07/15/2048	33,222	2,191,728	0.2
Series 2016-C36, Class XA(c)	1.23%	11/15/2059	49,078	2,148,703	0.2
Series 2016-LC24, Class XA(c)	1.62%	10/15/2049	26,646	1,563,195	0.2
Series 2016-LC25, Class AS(b)	3.87%	12/15/2059	2,216	2,304,328	0.2
Series 2016-LC25, Class XA(c)	0.83%	12/15/2059	70,023	2,300,503	0.2
Series 2017-C38, Class XA(c)	1.01%	07/15/2050	30,503	1,251,845	0.1
Series 2017-C39, Class A5	3.42%	09/15/2050	2,500	2,584,504	0.2
Series 2018-C46, Class AS	4.38%	08/15/2051	4,500	4,828,926	0.5
Series 2018-C48, Class A5	4.30%	01/15/2052	2,000	2,169,735	0.2
Series 2018-C48, Class XA(c)	0.95%	01/15/2052	45,648	2,522,885	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
<b>WF-RBS Commercial Mortgage Trust</b>					
Series 2011-C4, Class E	4.89%	06/15/2044	USD 713	\$ 549,330	0.1%
Series 2011-C5, Class E	5.52%	11/15/2044	1,023	1,021,488	0.1
Series 2012-C7, Class XA(c)	1.18%	06/15/2045	27,582	2,742	0.0
Series 2012-C8, Class E	4.85%	08/15/2045	2,110	2,086,585	0.2
Series 2012-C8, Class XA(c)	1.69%	08/15/2045	15,001	16,851	0.0
Series 2012-C9, Class D	4.81%	11/15/2045	615	609,465	0.1
Series 2012-C9, Class XA(c)	1.85%	11/15/2045	12,803	57,518	0.0
Series 2012-C10, Class B	3.74%	12/15/2045	2,500	2,480,142	0.2
Series 2012-C10, Class XA(c)	1.48%	12/15/2045	18,300	127,437	0.0
Series 2013-C11, Class AS	3.31%	03/15/2045	2,000	2,016,943	0.2
Series 2013-C11, Class XA(c)	1.13%	03/15/2045	16,395	88,668	0.0
Series 2014-C22, Class XA(c)	0.79%	09/15/2057	35,354	563,941	0.1
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	3,164	3,217,911	0.3
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	1,290	1,182,475	0.1
Series 2014-C25, Class XA(c)	0.80%	11/15/2047	22,452	425,918	0.0
				243,943,693	22.4
<b>NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS</b>					
Ashford Hospitality Trust, Series 2018-KEYS, Class A(a)	1.19%	06/15/2035	3,000	2,972,090	0.3
<b>BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust,</b>					
Series 2017-SCH, Class AF(a)	1.19%	11/15/2033	3,000	2,917,894	0.3
Braemar Hotels & Resorts Trust, Series 2018-PRME, Class A(a)	1.01%	06/15/2035	5,000	4,958,484	0.5
BX Trust, Series 2018-EXCL, Class A(a)	1.28%	09/15/2037	5,413	5,345,079	0.5
DBWF Mortgage Trust, Series 2018-GLKS, Class E(a)	3.18%	12/19/2030	2,420	2,353,328	0.2
Invitation Homes Trust, Series 2018-SFR3, Class A(a)	1.12%	07/17/2037	1,126	1,124,643	0.1
<b>Morgan Stanley Capital I Trust</b>					
Series 2019-BPR, Class D(a)	4.19%	05/15/2036	2,750	2,357,629	0.2
Series 2019-BPR, Class E(a)	4.94%	05/15/2036	2,250	1,632,493	0.1
				23,661,640	2.2
<b>STAATLICHE CMBS</b>					
<b>Federal Home Loan Mortgage Corp.,</b>					
Series 2021-MN1, Class M2(a)	3.80%	01/25/2051	1,700	1,616,620	0.2
				269,221,953	24.8
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>CLO – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
522 Funding CLO Ltd., Series 2021-7A, Class A(a)	1.33%	04/23/2034	7,000	6,927,424	0.6
AGL CLO 9 LTD., Series 2020-9A, Class D(a)	3.95%	01/20/2034	4,000	3,931,824	0.4
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class D(a)	3.14%	04/15/2034	3,500	3,405,041	0.3
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class E(a)	6.24%	04/15/2034	2,250	2,180,408	0.2
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class D(a)	3.39%	04/15/2034	3,000	2,937,963	0.3
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class E(a)	6.60%	04/15/2034	1,000	971,334	0.1
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class E(a)	6.40%	07/20/2034	3,250	3,131,027	0.3
AGL CLO 13 Ltd., Series 2021-13A, Class E(a)	6.66%	10/20/2034	4,000	3,878,176	0.4
AIG CLO Ltd., Series 2021-3A, Class D(a)	3.21%	01/25/2035	3,000	2,940,321	0.3
AIG CLO Ltd., Series 2021-3A, Class E(a)	6.57%	01/25/2035	3,400	3,286,352	0.3
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class D(a)	2.90%	04/20/2034	3,500	3,437,535	0.3
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class E(a)	6.00%	04/20/2034	3,250	3,113,503	0.3
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class D(a)	3.23%	10/20/2034	5,000	4,864,960	0.4
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class C(a)	3.85%	01/20/2034	2,000	1,965,286	0.2
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class D(a)	7.25%	01/20/2034	2,000	1,948,730	0.2
Ballyrock CLO 17 Ltd., Series 2021-17A, Class D(a)	6.12%	10/20/2034	2,000	1,905,032	0.2
Ballyrock CLO Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	6.05%	04/20/2031	1,000	923,706	0.1
Ballyrock CLO Ltd., Series 2021-16A, Class D(a)	6.50%	07/20/2034	3,500	3,333,158	0.3
<b>Benefit Street Partners CLO XXII Ltd,</b>					
Series 2020-22A, Class D(a)	3.75%	01/20/2032	1,000	985,909	0.1
<b>Benefit Street Partners CLO XXII Ltd,</b>					
Series 2020-22A, Class E(a)	7.25%	01/20/2032	1,500	1,461,164	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(a)	2.02%	04/26/2031	5,000	4,911,310	0.4
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class B(a)	3.31%	07/23/2032	4,125	3,974,413	0.4
BlueMountain Fuji US CLO II Ltd., Series 2017-2A, Class D(a)	6.40%	10/20/2030	1,000	948,831	0.1
Carlyle US CLO Ltd., Series 2017-3A, Class D(a)	6.36%	07/20/2029	1,500	1,386,875	0.1
Cedar Funding IX CLO Ltd., Series 2018-9A, Class E(a)	5.60%	04/20/2031	875	825,103	0.1
Dryden 57 CLO Ltd., Series 2018-57A, Class E(a)	5.71%	05/15/2031	1,750	1,636,882	0.1
Dryden 64 CLO Ltd., Series 2018-64A, Class B(a)	1.64%	04/18/2031	3,800	3,748,996	0.3
Galaxy XXIII CLO Ltd., Series 2017-23A, Class B1R(a)	1.61%	04/24/2029	1,350	1,338,544	0.1
<b>Goldentree Loan Management US CLO 7 Ltd.,</b>					
Series 2020-7A, Class DR(a)	3.40%	04/20/2034	1,000	989,764	0.1
<b>Goldentree Loan Opportunities XI Ltd.,</b>					
Series 2015-11A, Class BR2(a)	1.59%	01/18/2031	8,000	7,949,296	0.7
Greywolf CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A2(a)	1.90%	04/26/2031	5,000	4,946,610	0.5
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd., Series 2018-1A, Class C(a)	3.45%	07/21/2031	2,000	1,902,348	0.2
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class B(a)	1.79%	04/15/2034	3,000	2,951,739	0.3
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	6.70%	04/15/2034	3,000	2,877,723	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Jamestown CLO XI Ltd., Series 2018-11A, Class D(a)	6.26%	07/14/2031	USD 1,500	\$ 1,371,804	0.1%
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(a)	3.00%	10/20/2030	2,000	1,947,022	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-42A, Class E(a)	6.19%	07/16/2035	3,625	3,545,892	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-43A, Class D(a)	3.34%	07/17/2035	3,000	2,975,493	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class DR(a)	3.14%	10/16/2033	1,875	1,848,109	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class ER(a)	6.49%	10/16/2033	2,000	1,949,748	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class D(a)	3.85%	01/20/2032	1,250	1,228,986	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class E(a)	7.45%	01/20/2032	2,500	2,429,252	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 44 Ltd., Series 2021-44A, Class E(a)	6.24%	10/16/2034	1,500	1,465,832	0.1
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class D(a)	3.48%	10/20/2034	5,000	4,870,930	0.4
OCP CLO Ltd., Series 2018-15A, Class D(a)	6.10%	07/20/2031	1,000	958,027	0.1
Octagon Investment Partners 35 Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	5.45%	01/20/2031	3,000	2,741,424	0.2
OZLM XXII Ltd., Series 2018-22A, Class D(a)	5.54%	01/17/2031	1,750	1,540,922	0.1
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	6.25%	10/20/2034	2,830	2,742,898	0.2
Pikes Peak CLO 1, Series 2018-1A, Class E(a)	6.31%	07/24/2031	1,500	1,406,667	0.1
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class D(a)	3.90%	02/25/2034	5,000	4,971,750	0.5
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class A(a)	1.42%	07/20/2034	10,000	9,946,800	0.9
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class D(a)	3.35%	07/20/2034	5,000	4,879,080	0.4
PPM CLO 5 Ltd., Series 2021-5A, Class E(a)	6.62%	10/18/2034	1,400	1,349,289	0.1
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(a)	6.19%	07/15/2031	3,000	2,746,092	0.3
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2017-3A, Class B(a)	1.72%	10/20/2030	3,000	2,968,983	0.3
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	3.48%	05/20/2031	3,450	3,379,861	0.3
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2018-2A, Class B(a)	2.05%	10/20/2031	7,000	6,939,821	0.6
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	6.61%	07/20/2034	3,000	2,842,410	0.3
TCW CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(a)	6.31%	04/25/2031	2,250	2,144,498	0.2
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class B1R(a)	2.00%	07/20/2031	5,000	4,943,540	0.5
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class CR(a)	2.60%	07/20/2031	2,000	1,958,246	0.2
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class DR(a)	3.75%	07/20/2031	4,000	3,888,560	0.4
TIAA CLO Ltd., Series 2016-1A, Class AR(a)	1.45%	07/20/2031	2,000	1,987,392	0.2
TRESTLES CLO Ltd., Series 2018-2A, Class A2(a)	1.93%	07/25/2031	3,000	2,989,005	0.3
Venture XXVII CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(a)	4.25%	07/20/2030	1,500	1,500,425	0.1
Whehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class D(a)	0.00%	04/21/2035	3,000	3,000,000	0.3
				<u>193,376,045</u>	<u>17.8</u>
<b>ABS-ANLEIHEN</b>					
<b>SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS</b>					
Affirm Asset Securitization Trust, Series 2020-A, Class A	2.10%	02/18/2025	2,500	2,499,720	0.2
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I, Series 2019-HP1, Class B	3.48%	12/15/2026	2,800	2,817,603	0.3
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust Series 2018-P1, Class C	5.21%	07/15/2025	364	366,857	0.0
Series 2018-P2, Class C	5.21%	10/15/2025	375	377,164	0.0
Marlette Funding Trust, Series 2018-4A, Class C	4.91%	12/15/2028	1,800	1,803,280	0.2
Neighborly Issuer LLC, Series 2021-1A, Class A2	3.58%	04/30/2051	4,963	4,815,809	0.5
SoFi Consumer Loan Program Trust Series 2018-1, Class C	3.97%	02/25/2027	2,500	2,507,875	0.2
Series 2018-2, Class C	4.25%	04/26/2027	2,227	2,232,829	0.2
Series 2018-3, Class C	4.67%	08/25/2027	2,500	2,516,056	0.2
TGIF Funding LLC, Series 2017-1A, Class A2	6.20%	04/30/2047	5,618	5,376,897	0.5
Zaxby's Funding LLC, Series 2021-1A, Class A2	3.24%	07/30/2051	2,189	2,128,173	0.2
				<u>27,442,263</u>	<u>2.5</u>
<b>AUTOS – FESTVERZINSLICH</b>					
CPS Auto Receivables Trust, Series 2018-A, Class D	3.66%	12/15/2023	403	404,590	0.0
Flagship Credit Auto Trust, Series 2020-1, Class D	2.48%	03/16/2026	5,000	5,000,050	0.5
Foursight Capital Automobile Receivables Trust, Series 2020-1, Class D	2.60%	01/15/2026	2,080	2,081,609	0.2
				<u>7,486,249</u>	<u>0.7</u>
<b>BAUSPARDARLEHEN – FESTVERZINSLICH</b>					
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2005-WF1, Class A5	5.01%	11/25/2034	0*	45	0.0
				<u>34,928,557</u>	<u>3.2</u>
<b>HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN</b>					
<b>FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT</b>					
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2020	2.50%	06/01/2050	9,568	9,520,609	0.9
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold Pool, Series 2018	4.00%	10/01/2048	5,166	5,453,550	0.5
Federal National Mortgage Association, Series 2000	7.50%	10/01/2030	3	3,239	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.50%	06/01/2031	26	29,706	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Federal National Mortgage Association, Series 2003	5.00%	11/01/2033	USD 156	\$ 170,051	0.0%
Federal National Mortgage Association, Series 2004	8.00%	09/01/2033	363	413,214	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2008	5.00%	07/01/2037	162	175,698	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2008	5.50%	05/01/2038	199	224,851	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2009	5.00%	05/01/2039	83	91,810	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	02/01/2040	512	566,381	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	04/01/2040	646	715,908	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	12/01/2040	732	814,668	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2011	5.00%	04/01/2041	344	384,100	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2014	5.00%	08/01/2044	866	970,616	0.1
Government National Mortgage Association, Series 2009	5.00%	10/15/2039	154	171,004	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2012	5.50%	06/15/2038	52	56,889	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2014	5.00%	08/20/2041	494	537,054	0.1
				<u>20,299,348</u>	<u>1.9</u>
<b>FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 15-JÄHRIGER LAUFZEIT</b>					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2011	5.00%	07/01/2025	47	48,336	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2011	6.50%	03/01/2026	4	4,337	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2012	5.00%	06/01/2026	2	1,568	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2014	3.50%	02/01/2029	468	485,305	0.0
				<u>539,546</u>	<u>0.0</u>
				<u>20,838,894</u>	<u>1.9</u>
<b>INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT</b>					
<b>FINANZINSTITUTE</b>					
<b>FINANZEN</b>					
Curo Group Holdings Corp.	7.50%	08/01/2028	5,323	4,724,234	0.4
Enova International, Inc.	8.50%	09/15/2025	1,002	996,852	0.1
				<u>5,721,086</u>	<u>0.5</u>
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Cooks Venture, Inc., Series CLIP	5.50%	01/15/2025	2,520	2,520,000	0.3
				<u>8,241,086</u>	<u>0.8</u>
				<u>996,826,122</u>	<u>91.7</u>
<b>SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>					
<b>ABS-ANLEIHEN</b>					
<b>SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS</b>					
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-7, Class PT.	10.57%	06/15/2043	62	59,567	0.0
Series 2018-20, Class PT.	12.93%	11/16/2043	181	179,436	0.0
Series 2019-24, Class PT.	11.14%	08/15/2044	757	754,359	0.1
Series 2019-44, Class PT.	13.95%	11/15/2044	718	720,165	0.1
Consumer Loan Underlying Bond Club Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-4, Class PT.	12.21%	05/15/2043	49	48,011	0.0
Series 2018-12, Class PT.	14.26%	06/15/2043	119	116,736	0.0
Series 2019-48, Class PT.	14.80%	12/15/2044	674	672,814	0.1
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust,					
Series 2018-3, Class PT.	11.89%	03/16/2043	52	50,089	0.0
Dragonfly Energy Corp., Series CLIP(e)	5.50%	11/15/2024	3,500	3,517,500	0.3
SMB Private Education Loan Trust					
Series 2021-A, Class R(e)	0.00%	01/15/2053	3	10,637,250	1.0
Series 2021-C, Class R(e)	0.00%	01/15/2053	4	2,520,000	0.2
SoFi Consumer Loan Program LLC, Series 2016-1, Class R(e)	0.00%	08/25/2025	167	165,883	0.0
SoFi Consumer Loan Program Trust, Series 2018-1, Class R1(e)	0.00%	02/25/2027	25	384,358	0.0
				<u>19,826,168</u>	<u>1.8</u>
<b>AUTOS – FESTVERZINSLICH</b>					
Octane Receivables Trust					
Series 2020-1A, Class R1(e)	0.00%	03/20/2028	9	1,986,674	0.2
Series 2021-1A, Class R1(e)	0.00%	11/20/2028	5	1,764,515	0.2
Santander Consumer Auto Receivables Trust					
Series 2021-BA, Class R(e)	0.00%	03/15/2029	5	1,495,998	0.1
Series 2021-CA, Class R(e)	0.00%	06/15/2028	6	1,158,986	0.1
				<u>6,406,173</u>	<u>0.6</u>
				<u>26,232,341</u>	<u>2.4</u>
<b>BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Bellemeade Re Ltd., Series 2020-4A, Class B1(a)	5.19%	06/25/2030	500	503,969	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Series 2019-FTR2, Class B2(a)	7.59%	11/25/2048	1,000	992,062	0.1
Series 2019-FTR3, Class B2(a)	4.91%	09/25/2047	6,980	6,469,554	0.6
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit					
Risk Debt Notes, Series 2019-HQA1, Class B2(a)	12.44%	02/25/2049	750	827,934	0.1

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
<b>JPMorgan Madison Avenue Securities Trust</b>					
Series 2014-CH1, Class M2(a)	4.44%	11/25/2024	USD 677	\$ 664,133	0.1%
Series 2015-CH1, Class M2(a)	5.69%	10/25/2025	1,538	1,552,174	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2020-1R, Class A(a)	2.46%	02/27/2023	1,768	1,767,662	0.1
<b>Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust,</b>					
Series 2015-WF1, Class 1M2(a)	5.44%	11/25/2025	726	692,546	0.1
				<u>13,470,034</u>	<u>1.2</u>
<b>DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN</b>					
<b>NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS</b>					
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(e)	0.00%	03/10/2047	14	295,081	0.0
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(e)	4.00%	04/15/2050	226	3,730,043	0.4
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(e)	4.00%	11/15/2047	210	1,108,402	0.1
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(e)	3.40%	10/15/2057	217	3,640,889	0.3
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class XCP(c)	0.00%	05/15/2021	163,600	1,636	0.0
				<u>8,776,051</u>	<u>0.8</u>
<b>STAMMAKTIEN</b>					
Mt. Logan Re Ltd. (Preference Shares)(Series 1)(e)			4,000	3,648,457	0.3
Mt. Logan Re Ltd. (Special Investment)(e)			632	631,732	0.1
				<u>4,280,189</u>	<u>0.4</u>
<b>BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN</b>					
<b>CLO – VARIABEL VERZINSLICH</b>					
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-1RA, Class D(a)	3.29%	07/15/2030	USD 1,500	1,466,019	0.1
<b>SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN</b>					
<b>INDUSTRIE</b>					
<b>NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER</b>					
Virgolino de Oliveira Finance SA(e)(f)	10.88%	01/13/2020	1,665	167	0.0
				<u>54,224,801</u>	<u>4.9</u>
<b>Gesamtanlagen</b>					
(Kosten \$1,219,904,286)				\$ 1,051,050,923	96.6%
<b>Termineinlagen</b>					
ANZ, London(g)	(0.21)%	–		228	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(g)	0.01 %	–		44,764,510	4.2
BBH, Grand Cayman(g)	3.00 %	–		25,083	0.0
BNP Paribas, Paris(g)	0.01 %	–		141,888	0.0
BNP Paribas, Paris(g)	0.08 %	–		13	0.0
Sumitomo, Tokyo(g)	(0.78)%	–		2	0.0
<b>Termineinlagen insgesamt</b>				<u>44,931,724</u>	<u>4.2</u>
<b>Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten</b>				<u>(8,499,553)</u>	<u>(0.8)</u>
<b>Nettovermögen</b>				<u>\$ 1,087,483,094</u>	<u>100.0%</u>

**DEWISENTERMINGESCHÄFTE**

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	CNH 217	USD 34	03/04/2022	\$ (31)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 3,388	CNH 21,493	03/04/2022	17,641
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	CNH 217	USD 34	03/14/2022	(38)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	EUR 1,073	USD 1,213	03/14/2022	9,494
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 3,389	CNH 21,601	03/14/2022	31,252
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 8	EUR 7	03/14/2022	9
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 6,512	EUR 5,717	03/14/2022	(98,377)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	AUD 1,233	USD 887	03/18/2022	(9,222)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	EUR 1,067	USD 1,206	03/18/2022	9,229
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	GBP 42	USD 57	03/18/2022	718
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	GBP 2	USD 2	03/18/2022	(5)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	SGD 2,401	USD 1,784	03/18/2022	12,920
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 41,092	AUD 57,312	03/18/2022	544,295
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 8	EUR 7	03/18/2022	9
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 6,923	EUR 6,091	03/18/2022	(89,250)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 224	GBP 165	03/18/2022	(2,591)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 2,613	SGD 3,512	03/18/2022	(23,096)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	USD 9,052	ZAR 137,109	03/18/2022	(154,309)
Brown Brothers Harriman & Co.+. . . . .	ZAR 7,418	USD 491	03/18/2022	9,582
				<u>\$ 258,230</u>
			Wertsteigerung	\$ 635,149
			Wertminderung	\$ (376,919)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

**CREDIT-DEFAULT-SWAPS**

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
<b>Verkaufskontrakte</b>						
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,559	\$ (1,080,562)	\$ (298,476)	\$ (782,086)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	420	(177,527)	(64,132)	(113,395)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	659	(278,044)	(100,062)	(177,982)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,498	(1,054,622)	(370,746)	(683,876)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,992	(483,558)	(239,898)	(243,660)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,987	(725,337)	(317,523)	(407,814)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	801	(194,390)	(62,965)	(131,425)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,992	(483,558)	(267,023)	(216,535)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,489	(604,448)	(136,816)	(467,632)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,489	(604,448)	(151,427)	(453,021)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,119	(472,594)	(209,090)	(263,504)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,702	(718,618)	(315,935)	(402,683)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,053	(444,627)	(195,500)	(249,127)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,086	(458,408)	(198,673)	(259,735)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,880	(1,215,936)	(424,816)	(791,120)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,048	(497,340)	(264,038)	(233,302)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,489	(604,448)	(268,302)	(336,146)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	480	(202,656)	(98,761)	(103,895)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,281	(540,686)	(150,298)	(390,388)
Insgesamt				<u>\$ (10,841,807)</u>	<u>\$ (4,134,481)</u>	<u>\$ (6,707,326)</u>

\* Kapitalbetrag geringer als 500.

- (a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2022.
- (b) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 28. Februar 2022.
- (c) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (d) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte 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
- REMICs – Real Estate Mortgage Investment Conduits

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

**ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS**

28. Februar 2022

AB FCPI

	<b>Dynamic Diversified Portfolio (USD)</b>	<b>Global Equity Blend Portfolio (USD)</b>	<b>Global Value Portfolio (USD)</b>
<b>VERMÖGENSWERTE</b>			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert . . . . .	\$ 38,070,569	\$ 116,867,328	\$ 822,848,079
Termineinlagen . . . . .	3,216,510	2,280,493	9,918,214
Dividenden- und Zinsforderungen . . . . .	84,304	110,175	1,191,237
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel . . . . .	453,198	548,804	808,484
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren . . . . .	-0-	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften . . . . .	151,987	334,117	1,854,739
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital . . . . .	88,069	49,296	3,491,427
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren . . . . .	114,464	119,862	1,188,500
Zinsforderungen aus Swaps . . . . .	1,561	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten . . . . .	72,507	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps . . . . .	228,010	-0-	-0-
Forderungen aus der Wertpapierleihe . . . . .	-0-	54	14
Sonstige Forderungen . . . . .	-0-	-0-	-0-
	<u>42,481,179</u>	<u>120,310,129</u>	<u>841,300,694</u>
<b>VERBINDLICHKEITEN</b>			
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps . . . . .	90,529	-0-	-0-
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere . . . . .	732,819	614,906	6,497,622
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren . . . . .	5,567	-0-	-0-
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar . . . . .	61,829	22,510	-0-
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital . . . . .	75,306	64,843	1,475,628
Zu zahlende Dividenden . . . . .	-0-	-0-	761,461
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften . . . . .	144,211	247,112	1,094,311
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten . . . . .	101,598	-0-	-0-
Zinsaufwand für Swaps . . . . .	2,027	-0-	-0-
Verkaufte Optionen, zum Marktwert . . . . .	-0-	-0-	-0-
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten . . . . .	198,294	212,007	759,604
	<u>1,412,180</u>	<u>1,161,378</u>	<u>10,588,626</u>
<b>NETTOVERMÖGEN</b> . . . . .	<u>\$ 41,068,999</u>	<u>\$ 119,148,751</u>	<u>\$ 830,712,068</u>

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.



Emerging Markets Growth Portfolio (USD)	Asia Ex-Japan Equity Portfolio (USD)	Japan Strategic Value Portfolio (JPY)	China Low Volatility Equity Portfolio (USD)	Short Duration Bond Portfolio (USD)	Global High Yield Portfolio (USD)	American Income Portfolio (USD)
\$ 590,835,786	\$ 347,781,145	¥ 6,947,142,884	\$ 127,861,383	\$ 504,319,451	\$ 17,441,786,052	\$ 20,082,986,447
11,430,435	50,891	367,241,227	12,129,296	9,519,087	390,025,328	246,414,529
199,576	1,535,976	20,116,651	-0-	4,500,892	262,191,587	221,851,741
1,021,547	-0-	-0-	-0-	2,813,661	97,861,238	215,075,923
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	188,822,967	110,054,472
37,381	516,606	4,552,204	212,355	8,265,371	51,450,279	21,943,620
791,038	3,309,933	518,647,027	238,964	2,183,198	81,823,047	29,944,944
2,629,652	3,410,075	-0-	-0-	4,048,090	23,249,520	1,019,462
-0-	-0-	-0-	-0-	271,613	25,009,424	18,778,263
-0-	-0-	-0-	-0-	847,708	9,741,125	20,357,109
-0-	-0-	-0-	-0-	215,438	8,310,053	15,302,985
1,319	2,737	131,297	1,643	-0-	-0-	-0-
708	-0-	495,272	-0-	-0-	15,445	-0-
<u>606,947,442</u>	<u>356,607,363</u>	<u>7,858,326,562</u>	<u>140,443,641</u>	<u>536,984,509</u>	<u>18,580,286,065</u>	<u>20,983,729,495</u>
-0-	-0-	-0-	-0-	311,651	269,006,107	341,769,194
6,018,322	2,631,462	238,745,379	122	178,614	64,730,872	457,791,686
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	316,992,934	174,848,684
-0-	876,111	304,476,922	111,812	2,074,027	157,892,814	82,320,738
2,027,906	434,547	38,586,904	1,625,961	3,696,441	61,191,286	123,862,088
4,066	542,006	6,074,141	223,896	503,480	102,027,719	69,087,713
18,989	367,843	5,532,118	340,980	6,720,250	21,443,977	13,422,213
-0-	-0-	-0-	-0-	109,730	-0-	7,429,077
-0-	-0-	-0-	-0-	104,645	40	4,775,730
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	240,442
<u>1,164,308</u>	<u>1,416,183</u>	<u>27,314,587</u>	<u>326,370</u>	<u>699,041</u>	<u>30,476,113</u>	<u>24,066,079</u>
<u>9,233,591</u>	<u>6,268,152</u>	<u>620,730,051</u>	<u>2,629,141</u>	<u>14,397,879</u>	<u>1,023,761,862</u>	<u>1,299,613,644</u>
<u>\$ 597,713,851</u>	<u>\$ 350,339,211</u>	<u>¥ 7,237,596,511</u>	<u>\$ 137,814,500</u>	<u>\$ 522,586,630</u>	<u>\$ 17,556,524,203</u>	<u>\$ 19,684,115,851</u>

**ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS (Fortsetzung)**

28. Februar 2022

AB FCPI

	European Income Portfolio (EUR)	Emerging Markets Debt Portfolio (USD)	Mortgage Income Portfolio (USD)
<b>VERMÖGENSWERTE</b>			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert .....	€ 1,816,244,592	\$ 592,604,780	\$ 1,051,050,923
Termineinlagen. ....	7,506,268	39,192,160	44,931,724
Dividenden- und Zinsforderungen .....	33,199,492	9,639,413	5,325,063
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel .....	20,020,384	4,783,448	12,022,106
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren .....	-0-	1,507,753	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften .....	54,180,197	7,618,615	635,149
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital .....	1,803,149	2,318,312	2,688,458
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren .....	39,690,127	4,649,874	5,444,463
Zinsforderungen aus Swaps .....	-0-	-0-	122,531
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten .....	1,256,010	511,820	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps .....	-0-	3,867,092	-0-
Forderungen aus der Wertpapierleihe .....	-0-	-0-	-0-
Sonstige Forderungen .....	-0-	-0-	52,585
	<u>1,973,900,219</u>	<u>666,693,267</u>	<u>1,122,273,002</u>
<b>VERBINDLICHKEITEN</b>			
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps .....	-0-	-0-	6,707,326
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere .....	20,445,346	2,007,275	5,175,261
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren .....	-0-	193,939	4,134,481
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar .....	6,668,212	3,773,946	6,218,648
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital .....	28,675,414	624,144	8,360,142
Zu zahlende Dividenden .....	5,774,903	2,292,109	2,604,243
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften .....	38,709,420	6,493,658	376,919
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten .....	15,939,567	-0-	-0-
Zinsaufwand für Swaps .....	-0-	103,463	-0-
Verkaufte Optionen, zum Marktwert .....	-0-	-0-	-0-
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten .....	3,544,055	1,121,398	1,212,888
	<u>119,756,917</u>	<u>16,609,932</u>	<u>34,789,908</u>
<b>NETTOVERMÖGEN</b> .....	<u>€ 1,854,143,302</u>	<u>\$ 650,083,335</u>	<u>\$ 1,087,483,094</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.

**Kombiniert  
(USD)**

\$ 43,778,432,855*
780,957,088
543,850,932*
359,115,935
300,436,857
154,012,502
133,460,786
90,479,131
44,212,640
33,004,869
28,012,721
6,909
73,047
<u>46,246,056,272*</u>
617,981,884
572,105,481
496,249,899
263,527,230
235,927,740
184,315,553*
94,285,142
25,683,559
5,004,089
240,442
65,900,596
<u>2,561,221,615*</u>
<u>\$ 43,684,834,657*</u>

# ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS

Für den Zeitraum zum 28. Februar 2022

AB FCPI

	Dynamic Diversified Portfolio (USD)	Global Equity Blend Portfolio (USD)	Global Value Portfolio (USD)
<b>ANLAGEERTRÄGE</b>			
Zinsen . . . . .	\$ 117,646	\$ -0-	\$ 194
Swap-Erträge . . . . .	3,292	-0-	-0-
Dividenden, netto . . . . .	126,004	604,623	6,509,462
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto . . . . .	-0-	3,997	1,731
	<u>246,942</u>	<u>608,620</u>	<u>6,511,387</u>
<b>AUFWENDUNGEN</b>			
Verwaltungsgebühr . . . . .	270,818	510,973	3,338,532
Aufwendungen für Swaps . . . . .	6,110	-0-	-0-
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft . . . . .	20,869	21,374	223,423
Transferstelle . . . . .	56,620	44,007	71,947
Steuern . . . . .	10,065	12,625	113,003
Vertriebsgebühr . . . . .	5,514	4,437	789
Depotbankgebühren . . . . .	67,400	14,164	36,362
Gebühr für professionelle Dienstleistungen . . . . .	58,407	31,418	87,070
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr . . . . .	13,811	19,355	56,652
Druckkosten . . . . .	221	431	2,263
Sonstige Aufwendungen . . . . .	22,118	18,657	31,417
	<u>531,953</u>	<u>677,441</u>	<u>3,961,458</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen . . . . .	<u>(158,127)</u>	<u>(45,265)</u>	<u>-0-</u>
Nettoaufwendungen . . . . .	373,826	632,176	3,961,458
Netto-Anlageertrag/(-verlust) . . . . .	<u>(126,884)</u>	<u>(23,556)</u>	<u>2,549,929</u>
<b>REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)</b>			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen . . . . .	1,367,337	10,349,826	82,348,424
Kapitalertragsteuer . . . . .	255	1,855	(46,513)
<b>ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)</b>			
Aus Anlagen . . . . .	(4,401,115)	(21,346,694)	(125,486,566)
Aus Finanzterminkontrakten . . . . .	(41,658)	-0-	-0-
Aus Devisentermingeschäften . . . . .	(56,868)	(39,920)	(1,317,593)
Aus Swaps . . . . .	63,897	-0-	-0-
Aus verkauften Optionen . . . . .	-0-	-0-	-0-
Ergebnis der Geschäftstätigkeit . . . . .	<u>(3,195,036)</u>	<u>(11,058,489)</u>	<u>(41,952,319)</u>
<b>EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN</b>			
Steigerung/(Minderung) . . . . .	(1,057,315)	(6,133,043)	(54,300,245)
Ausschüttungen . . . . .	-0-	-0-	(4,371,389)
<b>NETTOVERMÖGEN</b>			
Beginn des Berichtszeitraums . . . . .	45,321,350	136,340,283	931,336,021
Anpassung aus Währungsumrechnung . . . . .	-0-	-0-	-0-
Ende des Berichtszeitraums . . . . .	<u>\$ 41,068,999</u>	<u>\$ 119,148,751</u>	<u>\$ 830,712,068</u>

(a) Die Finanzinformationen für das Sustainable US Thematic Portfolio beziehen sich auf den Zeitraum vom 1. September 2021 bis zum 28. Januar 2022. Siehe Anmerkung A.

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

Emerging Markets Growth Portfolio (USD)	Sustainable US Thematic Portfolio (USD) (a)	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)
\$ 501	\$ 1,306	\$ 830	¥ -0-	\$ 834	\$ 8,137,178	\$ 642,179,212
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	673,615	90,739,206
2,541,995	1,750,149	3,598,489	87,868,798	408,988	-0-	23,490,690
28,924	23,479	3,461	341,176	4,691	-0-	-0-
2,571,420	1,774,934	3,602,780	88,209,974	414,513	8,810,793	756,409,108
5,264,439	4,706,905	1,900,026	31,249,729	909,885	1,575,314	127,429,782
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	509,166	19,703,721
317,900	196,725	58,480	1,029,565	24,889	210,736	8,576,168
159,497	131,394	85,916	22,017	45,054	118,378	5,781,206
148,317	206,707	56,697	943,359	23,086	106,613	4,111,630
21,787	21,691	86,270	7,063	3,985	548	6,222,336
148,885	-0-	72,778	3,767,003	22,153	85,877	1,447,559
123,138	80,029	78,974	20,393,451	44,387	113,938	412,117
49,212	58,542	34,470	1,760,194	20,395	41,489	201,052
5,032	737	13,016	1,210,709	653	21,488	109,668
136,227	16,142	28,715	6,433,409	22,302	30,609	314,952
6,374,434	5,418,872	2,415,342	66,816,499	1,116,789	2,814,156	174,310,191
-0-	-0-	-0-	(23,685,852)	(28,240)	(49,084)	-0-
6,374,434	5,418,872	2,415,342	43,130,647	1,088,549	2,765,072	174,310,191
(3,803,014)	(3,643,938)	1,187,438	45,079,327	(674,036)	6,045,721	582,098,917
(4,227,084)	103,283,944	14,938,245	419,270,225	(4,624,296)	4,089,108	(304,878,127)
(537)	-0-	(317,969)	-0-	-0-	-0-	237,029
(89,049,244)	(209,432,087)	(33,653,921)	(396,062,978)	(15,204,583)	(19,554,300)	(1,333,744,685)
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	1,404,561	7,111,633
(30,549)	(205,943)	(838,807)	(4,615,819)	(780,439)	(1,699,975)	(6,355,551)
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	(384,141)	(32,561,609)
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	385,098
(97,110,428)	(109,998,024)	(18,685,014)	63,670,755	(21,283,354)	(10,099,026)	(1,087,707,295)
(47,098,135)	(867,655,502)	(1,585,980)	(1,271,734,007)	6,807,607	4,570,810	(1,500,491,972)
(35,711)	-0-	(3,238,908)	(37,340,602)	(1,306,825)	(3,169,495)	(661,222,444)
741,958,125	977,653,526	373,849,113	8,483,000,365	153,597,072	531,284,341	20,805,945,914
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
\$ 597,713,851	\$ -0-	\$ 350,339,211	¥ 7,237,596,511	\$ 137,814,500	\$ 522,586,630	\$ 17,556,524,203

# ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS (Fortsetzung)

Für den Zeitraum zum 28. Februar 2022

AB FCPI

	American Income Portfolio (USD)	European Income Portfolio (EUR)	Emerging Markets Debt Portfolio (USD)
<b>ANLAGEERTRÄGE</b>			
Zinsen	\$ 591,808,399	€ 51,420,187	\$ 25,098,478
Swap-Erträge	70,263,006	52,649	8,693
Dividenden, netto	17,501,941	-0-	-0-
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto	-0-	-0-	-0-
	<u>679,573,346</u>	<u>51,472,836</u>	<u>25,107,171</u>
<b>AUFWENDUNGEN</b>			
Verwaltungsgebühr	110,817,276	9,975,855	2,998,243
Aufwendungen für Swaps	17,489,183	130,931	356,819
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	10,050,856	917,521	142,674
Transferstelle	5,908,275	88,809	121,261
Steuern	4,774,171	449,203	133,508
Vertriebsgebühr	3,568,409	24,531	79,403
Depotbankgebühren	1,229,114	18,647	108,892
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	520,842	132,019	130,982
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	201,052	120,486	52,974
Druckkosten	150,395	14,359	4,062
Sonstige Aufwendungen	385,109	85,374	49,453
	<u>155,094,682</u>	<u>11,957,735</u>	<u>4,178,271</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	(120)	-0-	-0-
Nettoaufwendungen	<u>155,094,562</u>	<u>11,957,735</u>	<u>4,178,271</u>
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	<u>524,478,784</u>	<u>39,515,101</u>	<u>20,928,900</u>
<b>REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)</b>			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	(226,663,836)	37,708,224	(13,701,717)
Kapitalertragsteuer	-0-	-0-	-0-
<b>ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)</b>			
Aus Anlagen	(1,542,794,944)	(82,431,678)	(125,408,475)
Aus Finanzterminkontrakten	13,731,799	(23,482,207)	511,820
Aus Devisentermingeschäften	9,519,930	19,725,361	(2,751,156)
Aus Swaps	53,901,603	-0-	5,500,396
Aus verkauften Optionen	4,321,361	(492,233)	-0-
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	<u>(1,163,505,303)</u>	<u>(9,457,432)</u>	<u>(114,920,232)</u>
<b>EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN</b>			
(Minderung)	(3,533,988,262)	(342,355,512)	(90,924,693)
Ausschüttungen	(455,830,123)	(39,540,108)	(14,190,386)
<b>NETTOVERMÖGEN</b>			
Beginn des Berichtszeitraums	24,837,439,539	2,245,496,354	870,118,646
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Ende des Berichtszeitraums	<u>\$ 19,684,115,851</u>	<u>€ 1,854,143,302</u>	<u>\$ 650,083,335</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.

Mortgage Income Portfolio (USD)	Kombiniert (USD)
\$ 44,658,479	\$ 1,371,141,620
860,234	162,678,004
-0-	50,994,958*
-0-	69,286
45,518,713	1,584,883,868*
4,742,227	276,201,530
24,095	38,281,061
220,840	21,125,926
219,168	12,845,381
214,629	10,434,716
1,072	10,044,408
71,708	3,373,558
129,972	2,154,932
78,473	987,473
6,690	341,833
54,362	1,275,011
5,763,236	377,065,829
(357)	(489,628)
5,762,879	376,576,201
39,755,834	1,208,307,667*
(11,675,154)	(302,480,255)
-0-	(125,880)
(40,389,113)	(3,686,330,111)*
-0-	(4,356,220)
(558,111)	17,407,831
2,179,722	28,598,817
-0-	4,142,508
(10,686,822)	(2,734,835,643)*
(375,176,670)	(6,609,952,332)*
(20,426,327)	(1,203,314,240)*
1,493,772,913	54,360,039,002
-0-	(127,102,130)*
\$ 1,087,483,094	\$ 43,684,834,657*

KLASSE	Dynamic Diversified Portfolio	Global Equity Blend Portfolio	Global Value Portfolio
A .....	232,265	528,739	2,795,087
A EUR .....	8,113	20,545	229,131
A EUR H .....	36,935	208,263	-0-
A SGD .....	-0-	65,762	3,492,270
A SGD H .....	-0-	-0-	396,921
AD .....	-0-	-0-	1,845,816
AD AUD H .....	-0-	-0-	2,438,237
AD CAD H .....	-0-	-0-	391,162
AD EUR H .....	-0-	-0-	64,625
AD GBP H .....	-0-	-0-	249,427
AD HKD .....	-0-	-0-	1,024,856
AD SGD H .....	-0-	-0-	1,099
AD ZAR H .....	-0-	-0-	822,022
AX .....	540,127	-0-	-0-
AX EUR .....	1,701	-0-	-0-
AX SGD .....	11,596	-0-	-0-
B .....	-0-	29,635	8,592
B SGD .....	-0-	6,453	-0-
BX .....	41,126	-0-	-0-
BX SGD .....	42	-0-	-0-
C .....	90,891	179,362	182,491
C EUR .....	3,403	9,986	5,587
C EUR H .....	550	-0-	-0-
CX .....	59,570	-0-	-0-
I .....	511,560	65,527	3,133,431
I EUR .....	12,069	15,040	392,597
I EUR H .....	106,300	-0-	-0-
I GBP .....	-0-	-0-	493
I SGD .....	-0-	-0-	213,262
IX .....	1,609	-0-	-0-
S .....	-0-	-0-	3,338,767
S GBP .....	-0-	-0-	3,142
S GBP H .....	-0-	-0-	637,496
S HKD .....	-0-	641,601	-0-
S1 .....	-0-	247,930	10,546,308
S1 EUR .....	-0-	272	360
S1 EUR H .....	476	-0-	-0-
S1 GBP .....	-0-	277	4,025
S1 SGD .....	-0-	1,641,949	-0-
SD .....	-0-	-0-	1,106,778



KLASSE	Emerging Markets Growth Portfolio	Asia Ex-Japan Equity Portfolio	Japan Strategic Value Portfolio
A	9,950,269	810,861	34,813
A AUD H	169,180	230,507	667
A CZK H	-0-	-0-	424
A EUR	90,616	61,194	9,719
A EUR H	-0-	-0-	14,696
A HKD	17,783	62,045	-0-
A NZD H	-0-	-0-	833
A PLN	-0-	-0-	90
A PLN H	10,424	-0-	-0-
A SGD	1,467	-0-	984
A SGD H	2,373	4,786	578
A USD	-0-	-0-	39,999
A USD H	-0-	-0-	145,269
AD	4,521	1,745,707	11,611
AD AUD H	-0-	2,463,749	337,621
AD CAD H	-0-	573,790	-0-
AD EUR	-0-	37,906	-0-
AD EUR H	-0-	30,762	-0-
AD GBP H	-0-	261,610	-0-
AD HKD	-0-	790,746	-0-
AD NZD H	-0-	372,524	42,253
AD RMB H	-0-	1,018	-0-
AD SGD H	-0-	1,185	-0-
AD USD H	-0-	-0-	67,856
AD ZAR H	-0-	2,037,209	44,231
AY JPY	-0-	118,832,118	-0-
B	18,772	-0-	-0-
BD	-0-	11,647	-0-
BD AUD H	-0-	13,637	-0-
BD CAD H	-0-	1,723	-0-
BD HKD	-0-	8,979	-0-
BD NZD H	-0-	384	-0-
BY JPY	-0-	964,975,001	-0-
C	218,254	3,746	232
C AUD H	1,495	761	-0-
C EUR	3,122	102,182	147
C EUR H	-0-	-0-	521
C USD	-0-	-0-	1,020
ED	155,334	254,839	-0-
I	925,088	1,287,722	359
I AUD H	3,609	761	-0-
I EUR	190,671	5,830	21,527
I EUR H	-0-	-0-	367
I GBP	-0-	382	-0-
I SGD	-0-	-0-	100
I USD	-0-	-0-	27,020
I USD H	-0-	-0-	15,882
ID	-0-	1,074	-0-
ID AUD H	-0-	1,507	-0-
N	8,945	-0-	-0-
S	255	530,928	-0-
S EUR H	-0-	-0-	421
S HKD	-0-	616,433	-0-
S1	527,300	2,439,009	-0-
S1 EUR	128	311	74
S1 GBP	131	-0-	-0-
S1 USD	-0-	-0-	205,242
S1 USD H	-0-	-0-	482
SD	-0-	417,872	102,703

# UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

28. Februar 2022

AB FCPI

KLASSE	China Low Volatility Equity Portfolio	Short Duration Bond Portfolio	Global High Yield Portfolio
A	651,475	1,339,784	139,758,849
A EUR	20,315	15,011	1,782,139
A HKD	26,752	-0-	-0-
A PLN H	13,432	-0-	-0-
A2	-0-	8,712,347	47,433,021
A2 CHF H	-0-	-0-	587,858
A2 EUR	-0-	138,709	719,464
A2 EUR H	-0-	8,181	717,657
A2 HKD	-0-	70,034	464,028
A2 PLN H	-0-	-0-	107,294
A2 SGD	-0-	-0-	14,951
A2 SGD H	-0-	833	701,385
AA	-0-	254,955	291,137,459
AA AUD H	-0-	1,071,277	154,424,443
AA CAD H	-0-	754,424	1,386,186
AA EUR H	-0-	-0-	2,154,024
AA GBP H	-0-	432,158	4,916,702
AA HKD	-0-	847,109	14,834,582
AA NZD H	-0-	1,116	2,427,467
AA RMB H	-0-	-0-	4,661,704
AA SGD H	-0-	78,022	1,763,244
AA ZAR H	-0-	-0-	257,171,728
AD	388,172	-0-	-0-
AD AUD H	1,202,667	-0-	-0-
AD CAD H	80,676	-0-	-0-
AD EUR H	15,903	-0-	-0-
AD GBP H	49,007	-0-	-0-
AD HKD	173,256	-0-	-0-
AD NZD H	83,093	-0-	-0-
AD RMB H	951	-0-	-0-
AD SGD H	1,741	-0-	-0-
AD ZAR H	2,521,725	-0-	-0-
AJ	-0-	4,279,761	-0-
AK	-0-	-0-	19,716
AK EUR	-0-	-0-	118,237
AK EUR H	-0-	-0-	3,865
AR EUR H	-0-	698	60,723
AT	-0-	7,487,800	1,468,026,369
AT AUD H	-0-	569,644	84,237,877
AT CAD H	-0-	60,499	8,726,533
AT EUR	-0-	48,752	9,162,271
AT EUR H	-0-	10,018	5,858,673
AT GBP H	-0-	78,847	4,022,379
AT HKD	-0-	228,565	116,359,838
AT NZD H	-0-	68,796	11,586,596
AT RMB H	-0-	-0-	2,951,067
AT SGD	-0-	-0-	3,551,887
AT SGD H	-0-	26,069	21,157,288
AX	-0-	15,257	-0-
B	16,206	10,170	824,174
B EUR	310	-0-	-0-
B2	-0-	-0-	10,857
BA	-0-	-0-	8,305
BA AUD H	-0-	-0-	4,233
BD NZD H	1,248	-0-	-0-
BT	-0-	-0-	452,857
BT AUD H	-0-	-0-	100,672
BT CAD H	-0-	-0-	5,049
BT GBP H	-0-	-0-	27,075

KLASSE	China Low Volatility Equity Portfolio	Duration Bond Portfolio	Global High Yield Portfolio
BT HKD	-0-	-0-	20,162
BT NZD H	-0-	-0-	212
C	8,183	307,631	19,712,931
C EUR	2,772	-0-	10,919
C2	-0-	419,483	1,262,786
C2 EUR	-0-	-0-	5,401
C2 EUR H	-0-	457	10,524
CK	-0-	-0-	1,063
CK EUR H	-0-	-0-	720
CT	-0-	-0-	20,226
EA	-0-	-0-	169,766,104
EA AUD H	-0-	-0-	11,135,449
EA ZAR H	-0-	-0-	25,178,682
I	5,304	1,787,007	24,336,023
I EUR	312	1,275	125,188
I2	-0-	5,952,964	11,690,388
I2 AUD H	-0-	1,468	4,448
I2 CHF H	-0-	-0-	36,068
I2 EUR	-0-	717	34,035
I2 EUR H	-0-	428,116	1,119,605
I2 SGD	-0-	-0-	31,721
I2 SGD H	-0-	-0-	28,547
IA AUD H	-0-	-0-	138,952
IQD	-0-	-0-	16,538
IQD EUR	-0-	-0-	2,283
IT	-0-	200,768	3,590,147
IT AUD H	-0-	937	759,963
IT CAD H	-0-	-0-	65,958
IT EUR H	-0-	-0-	23,691
IT GBP H	-0-	-0-	183,652
IT HKD	-0-	-0-	49,439
IT NZD H	-0-	-0-	5,855
IT RMB H	-0-	-0-	11,030
J	-0-	-0-	4,223,738
N2	-0-	121,755	456,085
NT	-0-	170,032	1,217,821
S	169,025	519,223	-0-
S EUR H	-0-	1,041	-0-
S SGD H	-0-	833	-0-
S1	541,958	-0-	15,509,525
S1 2	-0-	2,747,155	-0-
S1 2 EUR	-0-	567	-0-
S1 EUR	98	-0-	320
S1 EUR H	-0-	1,041	-0-
S1D	-0-	-0-	43,092,274
SA	-0-	148,407	451,220
SHK	-0-	-0-	269,014
SK	-0-	-0-	12,511,719
W	-0-	-0-	90,072
W EUR	-0-	-0-	688
W2	-0-	-0-	154,413
W2 CHF H	-0-	-0-	7,008
W2 EUR H	-0-	-0-	73,870
WT	-0-	-0-	169,364
WT AUD H	-0-	-0-	170,662
WT CAD H	-0-	-0-	162,193
WT EUR H	-0-	-0-	223,072
WT GBP H	-0-	-0-	14,428
WT RMB H	-0-	-0-	384,276

# UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

28. Februar 2022

AB FCPI

KLASSE	American Income Portfolio	European Income Portfolio	Emerging Markets Debt Portfolio
A	163,742,698	2,591,552	977,221
A EUR	703,172	-0-	550
A USD	-0-	351,517	-0-
A2	58,803,129	3,111,218	447,850
A2 CHF H	324,009	9,145	600
A2 DUR PH	4,893	-0-	-0-
A2 EUR	1,189,888	-0-	185,838
A2 EUR H	1,624,899	-0-	42,534
A2 HKD	588,152	-0-	8,745
A2 PLN	-0-	-0-	6,119
A2 PLN H	873,467	2,264	368,355
A2 SGD	8,108	-0-	-0-
A2 SGD H	744,443	933	221,617
A2 USD	-0-	318,772	-0-
A2 USD H	-0-	445,362	-0-
AA	88,784,282	2,339,580	4,095,513
AA AUD H	30,088,210	11,310,241	3,361,334
AA CAD H	6,617,989	-0-	6,343
AA DUR PH	1,071,772	-0-	-0-
AA EUR H	1,162,308	-0-	1,175
AA GBP H	8,279,265	-0-	2,807
AA HKD	25,098,495	-0-	155,965
AA HKD H	-0-	6,506,684	-0-
AA NZD H	3,621,343	-0-	32,695
AA RMB H	5,420,781	743,866	1,169
AA SGD H	2,077,667	143,739	1,377
AA USD H	-0-	60,674,362	-0-
AA ZAR H	18,624,394	-0-	7,708,581
AI	-0-	-0-	4,967
AI AUD H	-0-	-0-	1,166
AK	40,876	131,921	-0-
AK EUR	48,756	-0-	-0-
AK EUR H	27,187	-0-	-0-
AR	-0-	2,167,003	-0-
AR EUR	6,697	-0-	1,771
AR EUR H	17,138	-0-	-0-
AT	722,222,734	14,760,029	8,362,948
AT AUD H	75,834,064	5,255,085	5,042,001
AT CAD H	20,711,463	-0-	134,948
AT DUR PH	55,711	-0-	-0-
AT EUR	5,680,349	-0-	59,345
AT EUR H	5,802,715	-0-	225,430
AT GBP H	13,087,720	-0-	27,099
AT HKD	188,304,163	-0-	686,766
AT NZD H	10,739,055	-0-	466,785
AT RMB H	3,590,955	-0-	7,063
AT SGD	1,472,304	-0-	-0-
AT SGD H	29,119,156	769,387	262,711
AT USD	-0-	732,657	-0-
AT USD H	-0-	17,057,908	-0-
B	761,984	-0-	-0-
B USD	-0-	146,865	-0-
B2	54,325	680	-0-
B2 HKD	7,736	-0-	1,615
B2 USD	-0-	1,300	-0-
BA	343,895	-0-	-0-
BA AUD H	158,661	234,850	-0-
BA USD H	-0-	95,316	-0-

KLASSE	American Income Portfolio	European Income Portfolio	Emerging Markets Debt Portfolio
BT	2,557,989	10,444	31,873
BT AUD H	650,179	13,654	-0-
BT CAD H	177,865	-0-	-0-
BT EUR H	44,858	-0-	695
BT GBP H	121,784	-0-	-0-
BT HKD	1,242,026	-0-	5,602
BT NZD H	129,358	-0-	-0-
BT USD H	-0-	114,184	-0-
C	24,442,848	1,055,555	250,369
C EUR	23,164	-0-	3,076
C USD	-0-	148,162	-0-
C2	6,520,466	60,553	105,745
C2 DUR PH	8,251	-0-	-0-
C2 EUR	70,829	-0-	843
C2 EUR H	5,857	-0-	-0-
C2 EUR H	-0-	-0-	541
C2 USD	-0-	9,584	-0-
C2 USD H	-0-	162,217	-0-
CK	-0-	9,001	-0-
CT	154,659	-0-	1,044
CT USD H	-0-	40,227	-0-
EA	30,328,944	-0-	920,908
EA AUD H	3,944,079	-0-	182,831
EA ZAR H	4,597,337	-0-	511,907
EI	-0-	-0-	168,776
EI AUD H	-0-	-0-	5,918
I	45,157,678	906,133	578,853
I EUR	72,064	-0-	-0-
I USD	-0-	361,817	-0-
I2	57,650,519	10,176,778	102,142
I2 AUD H	3,339,487	4,351	-0-
I2 CHF H	438,334	633	600
I2 DUR PH	1,900	-0-	-0-
I2 EUR	2,973,222	-0-	1,464
I2 EUR H	1,580,604	-0-	3,756,272
I2 HKD	135,706	-0-	-0-
I2 SGD	498	-0-	-0-
I2 SGD H	29,559	-0-	-0-
I2 USD	-0-	48,452	-0-
I2 USD H	-0-	342,820	-0-
IA	487,259	86,189	-0-
IA AUD H	3,897,737	-0-	-0-
IA HKD H	-0-	11,644	-0-
IA SGD H	-0-	1,388	-0-
IA USD H	-0-	126,761	-0-
IT	25,386,618	91,232	-0-
IT AUD H	612,592	-0-	1,818
IT CAD H	530,763	-0-	-0-
IT EUR H	285,881	-0-	1,333,333
IT GBP H	481,504	-0-	-0-
IT HKD	115,910	-0-	-0-
IT JPY	281,089	-0-	-0-
IT JPY H	309,809	-0-	-0-
IT NZD H	34,134	-0-	-0-
IT RMB H	343,437	-0-	-0-
IT SGD	31,898	-0-	-0-
IT SGD H	1,067,568	1,317	1,359

# UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

28. Februar 2022

AB FCPI

	American Income Portfolio	European Income Portfolio	Emerging Markets Debt Portfolio
<b>KLASSE</b>			
IT USD H .....	-0-	138,211	-0-
J .....	74,111,045	-0-	-0-
L2 .....	3,333	-0-	-0-
L2 AUD H .....	5,000	-0-	-0-
L2 SGD H .....	4,667	-0-	-0-
LT .....	3,770	-0-	-0-
LT AUD H .....	5,590	-0-	-0-
LT SGD H .....	5,216	-0-	-0-
N2 .....	4,309,218	-0-	11,779
NT .....	2,852,606	-0-	51,604
NT USD H .....	-0-	54,856	-0-
S .....	1,554,677	-0-	117,990
S EUR H .....	-0-	-0-	521
S GBP H .....	-0-	-0-	431
S1 .....	51,488,910	261,351	-0-
S1 2 .....	-0-	-0-	4,081,769
S1 2 EUR .....	-0-	-0-	266
S1 EUR .....	16,767	-0-	-0-
S1 EUR H .....	-0-	-0-	521
S1 GBP H .....	-0-	-0-	431
S1 USD .....	-0-	349	-0-
S1 USD H .....	-0-	9,949,274	-0-
S1D .....	29,579,010	1,112,155	-0-
S1D2 .....	338,238	-0-	-0-
SA .....	3,877,326	-0-	823,435
SA USD H .....	-0-	870,982	-0-
SHK .....	1,705,338	163,600	-0-
W .....	678,310	-0-	-0-
W2 .....	4,268,048	1,007,287	-0-
W2 CHF H .....	296,044	172,201	-0-
W2 EUR H .....	168,387	-0-	-0-
W2 USD H .....	-0-	4,667	-0-
WA .....	-0-	237,025	-0-
WA HKD H .....	-0-	918	-0-
WA USD H .....	-0-	136,632	-0-
WT .....	2,663,883	102,047	-0-
WT AUD H .....	1,128,343	-0-	-0-
WT EUR H .....	248,412	-0-	-0-
WT GBP H .....	27,887	-0-	-0-
WT HKD .....	238,594	-0-	-0-
WT SGD H .....	333,661	1,047	-0-
WT USD H .....	-0-	751	-0-

KLASSE	Mortgage Income Portfolio
A .....	9,094,129
A2 .....	5,790,151
A2 EUR .....	1,709
A2 HKD .....	4,917
A2 SGD .....	565
A2X .....	263,501
A2X EUR .....	55,348
AA .....	9,853,380
AA AUD H .....	4,700,334
AA HKD .....	6,635,823
AA RMB H .....	594,143
AA SGD H .....	65,742
AA ZAR H .....	1,837,017
AR EUR H .....	30,188
AT .....	2,843,263
AT AUD H .....	739,521
AT EUR .....	23,114
AT GBP H .....	9,851
AT HKD .....	74,104
AT SGD .....	814
AT SGD H .....	36,613
AX .....	468,164
AX EUR .....	3,356
BX .....	59,648
BX EUR .....	3,298
C .....	1,751,010
C2 .....	1,498,693
C2 EUR .....	507
CX .....	15,696
I .....	4,387,415
I EUR .....	3,381
I2 .....	7,645,258
I2 EUR .....	55,847
I2 EUR H .....	631,004
I2X .....	1,092
IT EUR H .....	3,704
IX .....	88,724
N2 .....	461,155
NT .....	471,215
S .....	382,797
S1 .....	17,273,637
S1 EUR .....	541
S1 EUR H .....	90
S1 JPY .....	1,433
S1X .....	2,300
SA .....	354,554

<b>Dynamic Diversified Portfolio</b>			
	<b>28. Februar 2022 (ungeprüft)</b>	<b>31. August 2021</b>	<b>31. August 2020</b>
Nettovermögen.....	\$ 41,068,999	\$ 45,321,350	\$ 42,312,154
Klasse			
A .....	\$ 22.55	\$ 24.23	\$ 20.37
A EUR (a) .....	€ 20.11	€ 20.52	€ 17.07
A EUR H .....	€ 19.66	€ 21.21	€ 18.04
AX .....	\$ 27.19	\$ 29.21	\$ 24.54
AX EUR (a) .....	€ 24.25	€ 24.73	€ 20.57
AX SGD .....	SGD 36.89	SGD 39.30	N/A
B .....	N/A	N/A	\$ 18.54
BX .....	\$ 22.90	\$ 24.71	\$ 20.98
BX SGD .....	SGD 31.08	SGD 33.27	N/A
C .....	\$ 21.94	\$ 23.61	\$ 19.91
C EUR (a) .....	€ 19.57	€ 20.00	€ 16.69
C EUR H .....	€ 19.14	€ 20.68	€ 17.65
CX .....	\$ 25.95	\$ 27.91	\$ 23.53
I .....	\$ 24.15	\$ 25.86	\$ 21.59
I EUR (a) .....	€ 21.54	€ 21.90	€ 18.10
I EUR H .....	€ 21.05	€ 22.63	€ 19.12
IX .....	\$ 30.43	\$ 32.57	\$ 27.18
S1 EUR H .....	€ 22.29	€ 23.91	€ 20.11

<b>Global Equity Blend Portfolio</b>			
	<b>28. Februar 2022 (ungeprüft)</b>	<b>31. August 2021</b>	<b>31. August 2020</b>
Nettovermögen.....	\$ 119,148,751	\$ 136,340,283	\$ 106,438,986
Klasse			
A .....	\$ 26.94	\$ 29.48	\$ 21.89
A EUR (a) .....	€ 24.02	€ 24.97	€ 18.35
A EUR H .....	€ 24.08	€ 26.48	€ 19.91
A SGD .....	SGD 36.55	SGD 39.67	N/A
B .....	\$ 22.39	\$ 24.63	\$ 18.47
B SGD .....	SGD 30.38	SGD 33.14	N/A
C .....	\$ 25.05	\$ 27.48	\$ 20.49
C EUR (a) (1) .....	€ 14.18	€ 23.28	€ 17.17
I .....	\$ 31.32	\$ 34.15	\$ 25.15
I EUR (a) .....	€ 27.93	€ 28.92	€ 21.08
S .....	N/A	N/A	\$ 30.16
S HKD .....	HKD 298.26	HKD 321.85	N/A
S1 .....	\$ 34.09	\$ 37.09	\$ 27.22
S1 EUR (a) .....	€ 30.40	€ 31.41	€ 22.81
S1 GBP .....	£ 25.42	£ 26.98	N/A
S1 SGD .....	SGD 46.25	SGD 49.91	N/A

<b>Global Value Portfolio</b>			
	<b>28. Februar 2022 (ungeprüft)</b>	<b>31. August 2021</b>	<b>31. August 2020</b>
Nettovermögen.....	\$ 830,712,068	\$ 931,336,021	\$ 366,088,109
Klasse			
A .....	\$ 20.94	\$ 22.10	\$ 16.51
A EUR (a) .....	€ 18.67	€ 18.72	€ 13.84
A SGD .....	SGD 28.42	SGD 29.74	N/A



Global Value Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
A SGD H	SGD 21.16	SGD 22.33	SGD 16.74
AD	\$ 15.67	\$ 16.83	\$ 13.04
AD AUD H	AUD 14.42	AUD 15.52	AUD 12.18
AD CAD H	CAD 14.79	CAD 15.90	CAD 12.43
AD EUR H	€ 15.41	€ 16.58	€ 12.93
AD GBP H	£ 14.82	£ 15.93	£ 12.48
AD HKD	HKD 122.46	HKD 130.89	N/A
AD SGD H	SGD 15.35	SGD 16.49	SGD 12.82
AD ZAR H	R 98.35	R 105.47	R 81.72
B	\$ 17.04	\$ 18.07	\$ 13.63
BD (2)	N/A	\$ 17.13	\$ 13.30
BD AUD H	N/A	N/A	AUD 12.25
BD EUR H	N/A	N/A	€ 12.96
BD ZAR H	N/A	N/A	R 82.18
C	\$ 19.27	\$ 20.38	\$ 15.29
C EUR (a)	€ 17.18	€ 17.26	€ 12.82
I	\$ 24.56	\$ 25.82	\$ 19.13
I EUR (a)	€ 21.90	€ 21.86	€ 16.03
I GBP (3)	£ 14.65	N/A	N/A
I SGD	SGD 33.32	SGD 34.74	N/A
S	\$ 28.86	\$ 30.21	\$ 22.18
S GBP	£ 21.53	£ 21.99	N/A
S GBP H	£ 22.60	£ 23.67	£ 17.55
S1	\$ 25.85	\$ 27.16	\$ 20.08
S1 EUR (a)	€ 23.06	€ 23.00	€ 16.83
S1 GBP	£ 19.28	£ 19.76	N/A
SD	\$ 106.08	\$ 113.75	\$ 87.93

Emerging Markets Growth Portfolio

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen	\$ 597,713,851	\$ 741,958,125	\$ 783,098,409
Klasse			
A	\$ 48.20	\$ 55.85	\$ 47.83
A AUD H	AUD 21.08	AUD 24.54	AUD 21.28
A EUR (a)	€ 42.98	€ 47.29	€ 40.09
A HKD	HKD 376.72	HKD 434.41	N/A
A PLN H	PLN 107.67	PLN 124.64	PLN 108.36
A SGD	SGD 65.41	SGD 75.15	N/A
A SGD H	SGD 16.44	SGD 19.07	SGD 16.40
AD	\$ 18.22	\$ 21.42	\$ 18.84
B	\$ 36.19	\$ 42.14	\$ 36.45
C	\$ 39.56	\$ 45.94	\$ 39.52
C AUD H	AUD 19.80	AUD 23.10	AUD 20.13
C EUR (a)	€ 35.28	€ 38.91	€ 33.12
ED	\$ 13.10	\$ 15.41	\$ 13.59
I	\$ 58.87	\$ 67.94	\$ 57.72
I AUD H	AUD 22.88	AUD 26.53	AUD 22.82
I EUR (a)	€ 52.50	€ 57.54	€ 48.38
N	\$ 23.68	\$ 27.50	\$ 23.65
S	\$ 70.84	\$ 81.32	\$ 68.35

Emerging Markets Growth Portfolio (Fortsetzung)			
	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
S1 .....	\$ 61.31	\$ 70.69	\$ 59.95
S1 EUR (a) .....	€ 54.69	€ 59.87	€ 50.25
S1 GBP .....	£ 45.73	£ 51.44	N/A
Sustainable US Thematic Portfolio*			
	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen .....	\$ 1,066,989,807	\$ 977,653,526	\$ 294,558,651
Klasse			
A .....	\$ 40.51	\$ 44.79	\$ 33.33
A AUD H .....	AUD 70.18	AUD 77.84	AUD 58.29
A CAD H .....	CAD 64.92	CAD 71.82	CAD 53.68
A EUR (a) .....	€ 36.33	€ 37.94	€ 27.94
A EUR H .....	€ 63.08	€ 69.98	€ 52.68
A GBP H .....	£ 52.99	£ 58.61	£ 43.78
A HKD .....	HKD 315.78	HKD 348.44	N/A
A SGD H .....	SGD 52.47	SGD 58.00	SGD 43.26
AN .....	\$ 78.09	\$ 86.34	\$ 64.25
B .....	\$ 33.05	\$ 36.69	\$ 27.57
C .....	\$ 38.35	\$ 42.48	\$ 31.76
C EUR (a) .....	€ 34.40	€ 35.98	€ 26.62
C EUR H .....	€ 60.37	€ 67.10	€ 50.73
C SGD .....	SGD 52.07	SGD 57.17	N/A
E .....	\$ 15.08	\$ 16.74	N/A
I .....	\$ 48.00	\$ 52.90	\$ 39.05
I EUR (a) .....	€ 43.05	€ 44.80	€ 32.73
I EUR H .....	€ 68.73	€ 76.00	€ 56.75
I GBP .....	£ 23.13	£ 24.84	£ 18.85
IN .....	\$ 85.67	\$ 94.40	\$ 69.69
IN EUR (a) .....	€ 76.84	€ 79.95	€ 58.41
S .....	\$ 65.60	\$ 72.04	\$ 52.74
S1 .....	\$ 50.69	\$ 55.82	\$ 41.13
S1 EUR (a) .....	€ 45.46	€ 47.27	€ 34.47
S1 JPY H .....	¥ 472.00	¥ 520.00	¥ 385.00
Asia Ex-Japan Equity Portfolio			
	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen .....	\$ 350,339,211	\$ 373,849,113	\$ 299,846,609
Klasse			
A .....	\$ 26.22	\$ 27.61	\$ 20.88
A AUD H .....	AUD 26.22	AUD 27.70	AUD 21.25
A EUR (a) .....	€ 23.38	€ 23.38	€ 17.50
A HKD .....	HKD 204.92	HKD 214.74	N/A
A SGD H .....	SGD 18.85	SGD 19.86	SGD 15.10
AD .....	\$ 16.76	\$ 17.93	\$ 14.00
AD AUD H .....	AUD 14.47	AUD 15.54	AUD 12.32
AD CAD H .....	CAD 12.31	CAD 13.21	CAD 10.41
AD EUR (a) .....	€ 14.96	€ 15.18	€ 11.73
AD EUR H .....	€ 15.30	€ 16.40	€ 12.92

Asia Ex-Japan Equity Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
AD GBP H	£ 15.23	£ 16.34	£ 12.90
AD HKD	HKD 130.99	HKD 139.44	N/A
AD NZD H	NZD 15.80	NZD 16.92	NZD 13.36
AD RMB H	CNH 104.46	CNH 111.59	CNH 87.37
AD SGD H	SGD 15.96	SGD 17.08	SGD 13.41
AD ZAR H	R 111.73	R 119.83	R 93.89
AY JPY	¥ 2.17	¥ 2.19	¥ 1.59
BD	\$ 16.65	\$ 17.83	\$ 13.96
BD AUD H	AUD 14.47	AUD 15.56	AUD 12.36
BD CAD H	CAD 12.85	CAD 13.80	CAD 10.89
BD GBP H	N/A	N/A	£ 12.94
BD HKD	HKD 130.17	HKD 138.72	N/A
BD NZD H	NZD 15.69	NZD 16.82	NZD 13.30
BD ZAR H (4)	N/A	R 107.61	R 84.35
BY JPY	¥ 2.07	¥ 2.09	¥ 1.53
C	\$ 24.82	\$ 26.19	\$ 19.90
C AUD H	AUD 25.36	AUD 26.85	AUD 20.68
C EUR (a)	€ 22.14	€ 22.17	€ 16.68
ED	\$ 14.37	\$ 15.36	\$ 11.99
I	\$ 28.93	\$ 30.34	\$ 22.76
I AUD H	AUD 29.35	AUD 30.88	AUD 23.50
I EUR (a)	€ 25.80	€ 25.70	€ 19.08
I GBP	£ 24.22	£ 24.79	£ 19.12
ID	\$ 16.81	\$ 17.97	\$ 14.02
ID AUD H	AUD 14.75	AUD 15.83	AUD 12.54
S	\$ 33.05	\$ 34.48	\$ 25.59
S HKD	HKD 258.32	HKD 268.21	N/A
S1	\$ 29.54	\$ 30.96	\$ 23.18
S1 EUR (a)	€ 26.35	€ 26.22	€ 19.43
SD	\$ 115.29	\$ 123.26	\$ 96.21

Japan Strategic Value Portfolio

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen	¥ 7,237,596,511	¥ 8,483,000,365	¥ 8,665,430,416
Klasse			
2	N/A	N/A	¥ 10,390.00
A	¥ 11,570.00	¥ 11,676.00	¥ 9,542.00
A AUD H	AUD 22.44	AUD 22.71	AUD 18.72
A CZK H	CZK 953.10	CZK 952.60	CZK 784.96
A EUR (a)	€ 89.81	€ 89.97	€ 75.53
A EUR H	€ 26.73	€ 27.12	€ 22.39
A NZD H	NZD 24.62	NZD 24.85	NZD 20.39
A PLN	PLN 422.62	PLN 406.65	N/A
A SGD	SGD 136.49	SGD 142.75	N/A
A SGD H	SGD 16.56	SGD 16.72	SGD 13.67
A USD (a)	\$ 100.67	\$ 106.17	\$ 90.05
A USD H	\$ 32.78	\$ 33.08	\$ 27.00

Japan Strategic Value Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
AD	¥ 11,567.00	¥ 11,823.00	¥ 9,930.00
AD AUD H	AUD 15.18	AUD 15.58	AUD 13.24
AD NZD H	NZD 15.66	NZD 16.06	NZD 13.60
AD USD H	\$ 15.13	\$ 15.48	\$ 13.04
AD ZAR H	R 106.38	R 108.96	R 91.42
B	N/A	N/A	¥ 8,294.00
B EUR	N/A	N/A	€ 65.65
BD	N/A	N/A	¥ 9,861.00
BD AUD H (5)	N/A	AUD 15.40	AUD 13.10
BD USD H	N/A	N/A	\$ 12.93
BD ZAR H	N/A	N/A	R 91.01
C	¥ 10,749.00	¥ 10,880.00	¥ 8,941.00
C EUR (a)	€ 83.51	€ 83.88	€ 70.77
C EUR H	€ 25.08	€ 25.51	€ 21.15
C USD (a)	\$ 93.57	\$ 98.97	\$ 84.38
I	¥ 13,089.00	¥ 13,154.00	¥ 10,672.00
I EUR (a)	€ 101.66	€ 101.40	€ 84.48
I EUR H	€ 29.34	€ 29.65	€ 24.28
I SGD	SGD 154.44	SGD 160.88	N/A
I USD (a)	\$ 113.91	\$ 119.65	\$ 100.72
I USD H	\$ 35.59	\$ 35.77	\$ 28.97
S EUR H	€ 29.24	€ 29.38	€ 23.77
S1	N/A	N/A	¥ 11,257.00
S1 EUR (a)	€ 108.00	€ 107.51	€ 89.11
S1 USD (a)	\$ 121.01	\$ 126.86	\$ 106.24
S1 USD H	\$ 25.70	\$ 25.78	\$ 20.76
SD	¥ 12,578.00	¥ 12,815.00	¥ 10,685.00

China Low Volatility Equity Portfolio

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen	\$ 137,814,500	\$ 153,597,072	\$ 146,211,198
Klasse			
A	\$ 55.97	\$ 64.41	\$ 67.15
A EUR (a)	€ 49.91	€ 54.54	€ 56.28
A HKD	HKD 437.40	HKD 501.00	N/A
A PLN H	PLN 93.27	PLN 107.36	PLN 113.07
AD	\$ 16.25	\$ 19.09	\$ 20.58
AD AUD H	AUD 14.59	AUD 17.23	AUD 18.76
AD CAD H	CAD 15.09	CAD 17.80	CAD 19.30
AD EUR H	€ 15.62	€ 18.37	€ 19.91
AD GBP H	£ 15.34	£ 18.08	£ 19.61
AD HKD	HKD 127.01	HKD 148.48	N/A
AD NZD H	NZD 15.00	NZD 17.67	NZD 19.21
AD RMB H	CNH 104.47	CNH 122.63	CNH 132.49
AD SGD H	SGD 15.41	SGD 18.12	SGD 19.59
AD ZAR H	R 98.40	R 116.49	R 125.78
B	\$ 43.87	\$ 50.74	\$ 53.42
B EUR (a)	€ 39.12	€ 42.97	€ 44.77
BD	N/A	N/A	\$ 20.62

China Low Volatility Equity Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
BD AUD H .....	N/A	N/A	AUD 18.74
BD EUR H .....	N/A	N/A	€ 19.87
BD NZD H .....	NZD 15.07	NZD 17.76	NZD 19.30
BD ZAR H (6) .....	N/A	R 117.43	R 126.91
C .....	\$ 52.31	\$ 60.34	\$ 63.19
C EUR (a) .....	€ 46.65	€ 51.10	€ 52.96
I .....	\$ 67.75	\$ 77.67	\$ 80.33
I EUR (a) .....	€ 60.42	€ 65.78	€ 67.33
S .....	\$ 85.41	\$ 97.41	\$ 99.71
S1 .....	\$ 75.94	\$ 86.93	\$ 89.66
S1 EUR (a) .....	€ 67.73	€ 73.63	€ 75.15

Short Duration Bond Portfolio

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen .....	\$ 522,586,630	\$ 531,284,341	\$ 570,960,697
Klasse			
A .....	\$ 7.37	\$ 7.59	\$ 7.76
A EUR (a) .....	€ 6.58	€ 6.43	€ 6.50
A2 .....	\$ 18.12	\$ 18.45	\$ 18.44
A2 EUR (a) .....	€ 16.16	€ 15.63	€ 15.46
A2 EUR H .....	€ 14.17	€ 14.48	€ 14.60
A2 HKD .....	HKD 141.65	HKD 143.56	N/A
A2 SGD H .....	SGD 15.31	SGD 15.59	SGD 15.58
AA .....	\$ 11.12	\$ 11.52	\$ 11.94
AA AUD H .....	AUD 10.94	AUD 11.34	AUD 11.80
AA CAD H .....	CAD 11.18	CAD 11.58	CAD 12.02
AA GBP H .....	£ 11.13	£ 11.53	£ 11.99
AA HKD .....	HKD 86.96	HKD 89.65	N/A
AA NZD H .....	NZD 11.28	NZD 11.67	NZD 12.11
AA SGD H .....	SGD 11.13	SGD 11.53	SGD 11.96
AJ .....	\$ 7.09	\$ 7.30	\$ 7.45
AR EUR H .....	€ 11.69	€ 11.95	€ 12.39
AT .....	\$ 7.36	\$ 7.58	\$ 7.76
AT AUD H .....	AUD 11.46	AUD 11.81	AUD 12.13
AT CAD H .....	CAD 11.63	CAD 11.98	CAD 12.27
AT EUR (a) .....	€ 6.57	€ 6.42	€ 6.50
AT EUR H .....	€ 11.27	€ 11.60	€ 11.88
AT GBP H .....	£ 11.72	£ 12.07	£ 12.38
AT HKD .....	HKD 57.56	HKD 58.97	N/A
AT NZD H .....	NZD 11.84	NZD 12.18	NZD 12.47
AT SGD H .....	SGD 12.01	SGD 12.36	SGD 12.65
AX .....	\$ 5.89	\$ 6.06	\$ 6.21
B .....	\$ 7.37	\$ 7.59	\$ 7.76
B2 .....	N/A	N/A	\$ 14.52
B2 EUR (a) (7) .....	N/A	€ 12.18	€ 12.17
BA .....	N/A	N/A	\$ 11.15
BT (8) .....	N/A	\$ 7.63	\$ 7.81
BT AUD H .....	N/A	N/A	AUD 12.16
BT CAD H .....	N/A	N/A	CAD 12.22

Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
BT GBP H	N/A	N/A	£ 12.39
BX	N/A	N/A	\$ 6.20
C	\$ 7.37	\$ 7.59	\$ 7.76
C2	\$ 14.90	\$ 15.21	\$ 15.26
C2 EUR H	€ 13.42	€ 13.74	€ 13.91
I	\$ 7.37	\$ 7.59	\$ 7.77
I EUR (a)	€ 6.58	€ 6.43	€ 6.51
I2	\$ 13.13	\$ 13.33	\$ 13.25
I2 AUD H	AUD 19.75	AUD 20.07	AUD 20.00
I2 EUR (a)	€ 11.71	€ 11.29	€ 11.11
I2 EUR H	€ 15.11	€ 15.41	€ 15.44
IT	\$ 12.10	\$ 12.46	\$ 12.75
IT AUD H	AUD 11.98	AUD 12.35	AUD 12.67
N2	\$ 14.43	\$ 14.73	\$ 14.79
NT	\$ 11.94	\$ 12.29	\$ 12.57
S	\$ 95.73	\$ 98.58	\$ 100.90
S EUR H	€ 16.25	€ 16.52	€ 16.48
S SGD H	SGD 17.76	SGD 17.99	SGD 17.79
S1 2	\$ 16.64	\$ 16.88	\$ 16.74
S1 2 EUR	€ 14.84	€ 14.29	N/A
S1 EUR H	€ 15.38	€ 15.66	€ 15.66
SA	\$ 83.06	\$ 85.58	\$ 87.69

Global High Yield Portfolio

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen	\$ 17,556,524,203	\$ 20,805,945,914	\$ 20,280,358,505
Klasse			
A	\$ 3.50	\$ 3.82	\$ 3.69
A EUR (a)	€ 3.13	€ 3.23	€ 3.09
A2	\$ 16.57	\$ 17.48	\$ 15.81
A2 CHF H	CHF 15.69	CHF 16.63	CHF 15.24
A2 EUR (a)	€ 14.78	€ 14.80	€ 13.25
A2 EUR H	€ 23.69	€ 25.09	€ 22.92
A2 HKD	HKD 129.51	HKD 135.99	N/A
A2 PLN H	PLN 103.57	PLN 108.67	PLN 98.88
A2 SGD	SGD 22.49	SGD 23.52	N/A
A2 SGD H	SGD 21.57	SGD 22.75	SGD 20.60
AA	\$ 9.51	\$ 10.47	\$ 10.31
AA AUD H	AUD 8.99	AUD 9.91	AUD 9.80
AA CAD H	CAD 9.07	CAD 9.99	CAD 9.87
AA EUR H	€ 9.24	€ 10.17	€ 10.03
AA GBP H	£ 9.06	£ 9.99	£ 9.87
AA HKD	HKD 74.36	HKD 81.46	N/A
AA NZD H	NZD 9.09	NZD 10.01	NZD 9.88
AA RMB H	CNH 62.57	CNH 68.85	CNH 67.73
AA SGD H	SGD 9.33	SGD 10.26	SGD 10.11
AA ZAR H	R 61.77	R 67.97	R 66.68
AK	\$ 11.40	\$ 12.43	\$ 12.05
AK EUR (a)	€ 10.17	€ 10.54	€ 10.10

## Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
AK EUR H	€ 11.23	€ 12.24	€ 11.89
AR EUR H	€ 10.13	€ 10.73	€ 10.60
AT	\$ 3.47	\$ 3.78	\$ 3.66
AT AUD H	AUD 11.67	AUD 12.74	AUD 12.39
AT CAD H	CAD 10.65	CAD 11.63	CAD 11.28
AT EUR (a)	€ 3.10	€ 3.20	€ 3.07
AT EUR H	€ 11.88	€ 12.95	€ 12.55
AT GBP H	£ 11.79	£ 12.87	£ 12.50
AT HKD	HKD 27.12	HKD 29.42	N/A
AT NZD H	NZD 10.79	NZD 11.75	NZD 11.40
AT RMB H	CNH 77.41	CNH 84.34	CNH 81.49
AT SGD	SGD 4.71	SGD 5.09	N/A
AT SGD H	SGD 10.84	SGD 11.82	SGD 11.44
B	\$ 3.50	\$ 3.82	\$ 3.69
B2	\$ 23.60	\$ 25.02	\$ 22.85
B2 EUR H	N/A	N/A	€ 20.59
BA	\$ 8.71	\$ 9.64	\$ 9.58
BAAUD H	AUD 8.22	AUD 9.11	AUD 9.11
BA ZAR H (9)	N/A	R 62.10	R 61.54
BT	\$ 3.54	\$ 3.86	\$ 3.73
BT AUD H	AUD 11.68	AUD 12.75	AUD 12.40
BT CAD H	CAD 10.67	CAD 11.64	CAD 11.28
BT EUR H (10)	N/A	€ 12.98	€ 12.59
BT GBP H	£ 11.82	£ 12.89	£ 12.52
BT HKD	HKD 27.66	HKD 30.00	N/A
BT NZD H	NZD 10.91	NZD 11.88	NZD 11.52
C	\$ 3.50	\$ 3.82	\$ 3.69
C EUR (a)	€ 3.12	€ 3.23	€ 3.10
C2	\$ 23.25	\$ 24.59	\$ 22.35
C2 EUR (a)	€ 20.73	€ 20.82	€ 18.73
C2 EUR H	€ 18.66	€ 19.81	€ 18.19
CK	\$ 11.37	\$ 12.40	\$ 12.02
CK EUR H	€ 11.22	€ 12.24	€ 11.87
CT	\$ 11.80	\$ 12.86	\$ 12.44
EA	\$ 11.47	\$ 12.66	\$ 12.53
EA AUD H	AUD 11.92	AUD 13.18	AUD 13.11
EA ZAR H	R 80.69	R 89.01	R 87.81
I	\$ 3.51	\$ 3.82	\$ 3.69
I EUR (a)	€ 3.13	€ 3.23	€ 3.09
I2	\$ 10.62	\$ 11.17	\$ 10.05
I2 AUD H	AUD 28.55	AUD 30.10	AUD 27.21
I2 CHF H	CHF 16.27	CHF 17.20	CHF 15.68
I2 EUR (a)	€ 9.47	€ 9.46	€ 8.43
I2 EUR H	€ 25.18	€ 26.61	€ 24.19
I2 SGD	SGD 14.41	SGD 15.03	N/A
I2 SGD H	SGD 18.71	SGD 19.69	SGD 17.74
IA AUD H	AUD 11.46	AUD 12.60	AUD 12.41
IQD	\$ 11.14	\$ 12.16	\$ 11.78
IQD EUR (a)	€ 9.96	€ 10.30	€ 9.87
IT	\$ 10.89	\$ 11.88	\$ 11.49

Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
IT AUD H	AUD 10.36	AUD 11.32	AUD 11.00
IT CAD H	CAD 12.70	CAD 13.85	CAD 13.44
IT EUR H	€ 11.79	€ 12.85	€ 12.46
IT GBP H	£ 12.66	£ 13.81	£ 13.42
IT HKD	HKD 85.14	HKD 92.38	N/A
IT NZD H	NZD 12.60	NZD 13.73	NZD 13.33
IT RMB H	CNH 73.89	CNH 80.53	CNH 77.82
J	\$ 3.77	\$ 4.11	\$ 3.97
N2	\$ 19.15	\$ 20.26	\$ 18.43
NT	\$ 11.17	\$ 12.17	\$ 11.77
S EUR H	N/A	N/A	€ 106.45
S1	\$ 28.56	\$ 30.03	\$ 26.99
S1 EUR (a)	€ 25.47	€ 25.43	€ 22.62
S1D	\$ 16.75	\$ 17.98	\$ 16.85
SA	\$ 73.43	\$ 80.17	\$ 77.65
SHK	\$ 81.18	\$ 88.60	\$ 85.84
SK	\$ 38.41	\$ 40.34	\$ 36.16
SQ	N/A	N/A	\$ 95.19
W	\$ 13.20	\$ 14.39	\$ 13.96
W EUR (a)	€ 11.78	€ 12.19	€ 11.70
W2	\$ 16.42	\$ 17.27	\$ 15.52
W2 CHF H	CHF 14.83	CHF 15.66	CHF 14.27
W2 EUR H	€ 15.17	€ 16.02	€ 14.53
WT	\$ 12.01	\$ 13.10	\$ 12.69
WT AUD H	AUD 11.52	AUD 12.59	AUD 12.26
WT CAD H	CAD 12.89	CAD 14.06	CAD 13.66
WT EUR H	€ 11.83	€ 12.90	€ 12.53
WT GBP H	£ 12.82	£ 13.99	£ 13.61
WT RMB H	CNH 87.22	CNH 95.08	CNH 92.01

American Income Portfolio

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen	\$ 19,684,115,851	\$ 24,837,439,539	\$ 28,197,385,467
Klasse			
A	\$ 7.53	\$ 8.12	\$ 8.17
A EUR (a)	€ 6.72	€ 6.88	€ 6.85
A2	\$ 31.21	\$ 32.84	\$ 31.47
A2 CHF H	CHF 16.25	CHF 17.19	CHF 16.67
A2 DUR PH	\$ 18.40	\$ 18.86	\$ 17.89
A2 EUR (a)	€ 27.83	€ 27.81	€ 26.37
A2 EUR H	€ 19.37	€ 20.47	€ 19.80
A2 HKD	HKD 243.90	HKD 255.44	N/A
A2 PLN H	PLN 104.99	PLN 109.95	PLN 105.80
A2 SGD	SGD 42.35	SGD 44.19	N/A
A2 SGD H	SGD 21.20	SGD 22.30	SGD 21.39
AA	\$ 11.50	\$ 12.51	\$ 12.75
AA AUD H	AUD 11.10	AUD 12.08	AUD 12.36
AA CAD H	CAD 11.01	CAD 11.97	CAD 12.23
AA DUR PH	\$ 10.95	\$ 11.59	\$ 11.69



## American Income Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
AA EUR H	€ 11.06	€ 12.02	€ 12.27
AA GBP H	£ 10.92	£ 11.89	£ 12.16
AA HKD	HKD 89.91	HKD 97.28	N/A
AA NZD H	NZD 11.03	NZD 11.99	NZD 12.25
AA RMB H	CNH 75.10	CNH 81.62	CNH 83.13
AA SGD H	SGD 11.25	SGD 12.23	SGD 12.47
AA ZAR H	R 76.16	R 82.71	R 83.92
AK	\$ 12.52	\$ 13.53	\$ 13.62
AK EUR (a)	€ 11.19	€ 11.46	€ 11.42
AK EUR H	€ 12.36	€ 13.36	€ 13.46
AR EUR	€ 12.01	€ 12.00	€ 12.13
AR EUR H	€ 11.56	€ 12.21	€ 12.48
AT	\$ 7.52	\$ 8.12	\$ 8.16
AT AUD H	AUD 12.50	AUD 13.51	AUD 13.64
AT CAD H	CAD 12.44	CAD 13.43	CAD 13.53
AT DUR PH	\$ 12.33	\$ 12.95	\$ 12.89
AT EUR (a)	€ 6.72	€ 6.87	€ 6.84
AT EUR H	€ 12.46	€ 13.45	€ 13.54
AT GBP H	£ 12.35	£ 13.33	£ 13.46
AT HKD	HKD 58.78	HKD 63.13	N/A
AT NZD H	NZD 11.91	NZD 12.85	NZD 12.96
AT RMB H	CNH 84.41	CNH 91.05	CNH 91.47
AT SGD	SGD 10.21	SGD 10.92	N/A
AT SGD H	SGD 12.53	SGD 13.52	SGD 13.62
B	\$ 7.53	\$ 8.12	\$ 8.17
B2	\$ 24.71	\$ 26.09	\$ 25.17
B2 HKD	HKD 193.11	HKD 202.95	N/A
BA	\$ 10.83	\$ 11.82	\$ 12.13
BAAUD H	AUD 10.41	AUD 11.38	AUD 11.74
BA ZAR H (11)	N/A	R 78.64	R 80.27
BT	\$ 7.58	\$ 8.18	\$ 8.23
BT AUD H	AUD 12.58	AUD 13.59	AUD 13.72
BT CAD H	CAD 12.34	CAD 13.31	CAD 13.42
BT EUR (a) (12)	N/A	€ 6.93	€ 6.90
BT EUR H	€ 12.47	€ 13.45	€ 13.55
BT GBP H	£ 12.43	£ 13.43	£ 13.55
BT HKD	HKD 59.27	HKD 63.64	N/A
BT NZD H	NZD 11.98	NZD 12.92	NZD 13.02
C	\$ 7.53	\$ 8.12	\$ 8.17
C EUR (a)	€ 6.72	€ 6.88	€ 6.85
C2	\$ 37.86	\$ 39.93	\$ 38.44
C2 DUR PH	\$ 17.68	\$ 18.16	\$ 17.30
C2 EUR (a)	€ 33.76	€ 33.82	€ 32.21
C2 EUR H	€ 18.42	€ 19.51	€ 18.95
CT	\$ 12.60	\$ 13.59	\$ 13.67
EA	\$ 13.19	\$ 14.38	\$ 14.73
EA AUD H	AUD 12.84	AUD 14.02	AUD 14.43
EA ZAR H	R 87.72	R 95.55	R 97.34
I	\$ 7.53	\$ 8.12	\$ 8.17
I EUR (a)	€ 6.72	€ 6.88	€ 6.85

## American Income Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
I2	\$ 18.68	\$ 19.61	\$ 18.68
I2 AUD H	AUD 16.45	AUD 17.29	AUD 16.54
I2 CHF H	CHF 17.10	CHF 18.03	CHF 17.40
I2 DUR PH	\$ 19.07	\$ 19.49	\$ 18.39
I2 EUR (a)	€ 16.66	€ 16.60	€ 15.66
I2 EUR H	€ 21.04	€ 22.17	€ 21.32
I2 HKD	HKD 146.00	HKD 152.50	N/A
I2 SGD	SGD 25.35	SGD 26.38	N/A
I2 SGD H	SGD 19.03	SGD 19.96	SGD 19.04
IA	\$ 13.19	\$ 14.30	\$ 14.50
IA AUD H	AUD 12.79	AUD 13.89	AUD 14.13
IT	\$ 12.28	\$ 13.25	\$ 13.33
IT AUD H	AUD 11.69	AUD 12.64	AUD 12.76
IT CAD H	CAD 13.57	CAD 14.64	CAD 14.77
IT EUR H	€ 13.57	€ 14.65	€ 14.75
IT GBP H	£ 13.48	£ 14.57	£ 14.70
IT HKD	HKD 95.95	HKD 103.07	N/A
IT JPY	¥ 9,657.00	¥ 9,954.00	¥ 9,632.00
IT JPY H	¥ 7,929.00	¥ 8,565.00	¥ 8,619.00
IT NZD H	NZD 13.53	NZD 14.60	NZD 14.72
IT RMB H	CNH 91.89	CNH 99.14	CNH 99.66
IT SGD	SGD 16.66	SGD 17.83	N/A
IT SGD H	SGD 12.68	SGD 13.68	SGD 13.77
J	\$ 7.68	\$ 8.28	\$ 8.33
L2	\$ 15.43	\$ 16.22	\$ 15.50
L2 AUD H	AUD 15.00	AUD 15.78	AUD 15.13
L2 SGD H	SGD 15.29	SGD 16.06	SGD 15.36
LT	\$ 13.58	\$ 14.66	\$ 14.75
LT AUD H	AUD 13.35	AUD 14.43	AUD 14.57
LT SGD H	SGD 13.62	SGD 14.69	SGD 14.79
N2	\$ 18.36	\$ 19.38	\$ 18.67
NT	\$ 12.24	\$ 13.21	\$ 13.29
S	\$ 21.66	\$ 22.65	\$ 21.43
S1	\$ 24.16	\$ 25.33	\$ 24.08
S1 EUR (a)	€ 21.55	€ 21.45	€ 20.18
S1D	\$ 15.25	\$ 16.32	\$ 16.16
S1D2	\$ 89.09	\$ 96.17	\$ 96.73
SA	\$ 84.95	\$ 91.74	\$ 92.31
SHK	\$ 88.30	\$ 95.32	\$ 95.92
W	\$ 13.55	\$ 14.62	\$ 14.71
W2	\$ 17.23	\$ 18.07	\$ 17.19
W2 CHF H	CHF 15.56	CHF 16.39	CHF 15.79
W2 EUR H	€ 15.78	€ 16.61	€ 15.96
WT	\$ 13.56	\$ 14.64	\$ 14.72
WT AUD H	AUD 13.16	AUD 14.23	AUD 14.37
WT EUR H	€ 13.65	€ 14.73	€ 14.83
WT GBP H	£ 13.46	£ 14.54	£ 14.67
WT HKD	HKD 106.00	HKD 113.86	N/A
WT SGD H	SGD 13.46	SGD 14.53	SGD 14.63

	European Income Portfolio		
	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen .....	€ 1,854,143,302	€ 2,245,496,354	€ 2,426,429,717
Klasse			
A .....	€ 6.44	€ 6.87	€ 6.78
A USD (a) .....	\$ 7.21	\$ 8.11	\$ 8.09
A2 .....	€ 21.08	€ 22.14	€ 21.14
A2 CHF H .....	CHF 16.13	CHF 16.97	CHF 16.26
A2 PLN H .....	PLN 106.46	PLN 110.81	PLN 105.30
A2 SGD H .....	SGD 18.32	SGD 19.17	SGD 18.16
A2 USD (a) .....	\$ 23.64	\$ 26.14	\$ 25.22
A2 USD H .....	\$ 18.98	\$ 19.86	\$ 18.81
AA .....	€ 11.74	€ 12.63	€ 12.65
AA AUD H .....	AUD 11.50	AUD 12.39	AUD 12.42
AA HKD H .....	HKD 77.98	HKD 83.93	HKD 84.16
AA RMB H .....	CNH 78.30	CNH 84.11	CNH 84.01
AA SGD H .....	SGD 11.64	SGD 12.52	SGD 12.51
AA USD H .....	\$ 11.85	\$ 12.75	\$ 12.75
AK .....	€ 13.55	€ 14.49	€ 14.30
AR .....	€ 11.88	€ 12.48	€ 12.52
AT .....	€ 6.44	€ 6.88	€ 6.78
AT AUD H .....	AUD 13.74	AUD 14.70	AUD 14.53
AT SGD H .....	SGD 13.09	SGD 13.98	SGD 13.76
AT USD (a) .....	\$ 7.21	\$ 8.12	\$ 8.09
AT USD H .....	\$ 14.10	\$ 15.06	\$ 14.84
B .....	N/A	N/A	€ 6.78
B USD (a) .....	\$ 7.21	\$ 8.11	\$ 8.09
B2 .....	€ 18.00	€ 18.98	€ 18.25
B2 USD (a) .....	\$ 20.19	\$ 22.41	\$ 21.77
BA (13) .....	N/A	€ 11.95	€ 12.05
BA AUD H .....	AUD 10.84	AUD 11.72	AUD 11.84
BA USD H .....	\$ 11.17	\$ 12.06	\$ 12.16
BT .....	€ 6.44	€ 6.88	€ 6.78
BT AUD H .....	AUD 13.80	AUD 14.74	AUD 14.57
BT USD (a) (14) .....	N/A	\$ 8.12	\$ 8.09
BT USD H .....	\$ 14.10	\$ 15.06	\$ 14.84
C .....	€ 6.44	€ 6.87	€ 6.78
C USD (a) .....	\$ 7.21	\$ 8.11	\$ 8.09
C2 .....	€ 19.89	€ 20.94	€ 20.09
C2 USD (a) .....	\$ 22.31	\$ 24.73	\$ 23.97
C2 USD H .....	\$ 18.07	\$ 18.95	\$ 18.02
CK .....	€ 13.54	€ 14.47	€ 14.28
CT USD H .....	\$ 12.99	\$ 13.88	\$ 13.68
I .....	€ 6.44	€ 6.87	€ 6.78
I USD (a) .....	\$ 7.21	\$ 8.11	\$ 8.09
I2 .....	€ 14.17	€ 14.84	€ 14.09
I2 AUD H .....	AUD 30.51	AUD 31.88	AUD 30.13
I2 CHF H .....	CHF 16.47	CHF 17.29	CHF 16.73
I2 USD (a) .....	\$ 15.88	\$ 17.52	\$ 16.81
I2 USD H .....	\$ 27.10	\$ 28.28	\$ 26.62
IA .....	€ 12.92	€ 13.86	€ 13.79

European Income Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
IA HKD H	HKD 86.43	HKD 92.75	HKD 92.47
IA SGD H	SGD 12.89	SGD 13.82	SGD 13.72
IA USD H	\$ 13.10	\$ 14.05	\$ 13.97
IT	€ 13.61	€ 14.54	€ 14.34
IT SGD H	SGD 13.61	SGD 14.53	SGD 14.29
IT USD H	\$ 13.38	\$ 14.29	\$ 14.07
NT USD H	\$ 13.66	\$ 14.59	\$ 14.38
S	N/A	N/A	€ 114.26
S1	€ 23.22	€ 24.30	€ 23.03
S1 USD (a)	\$ 26.04	\$ 28.69	\$ 27.48
S1 USD H	\$ 25.41	\$ 26.49	\$ 24.89
S1D	€ 13.47	€ 14.39	€ 14.20
SA USD H	\$ 88.73	\$ 94.84	\$ 93.62
SHK	€ 88.81	€ 94.85	€ 93.55
W2	€ 15.27	€ 15.98	€ 15.16
W2 CHF H	CHF 15.86	CHF 16.63	CHF 15.82
W2 USD H	\$ 15.79	\$ 16.46	\$ 15.47
WA	€ 13.65	€ 14.63	€ 14.53
WA HKD H	HKD 91.23	HKD 97.78	HKD 97.28
WA USD H	\$ 13.73	\$ 14.71	\$ 14.60
WT	€ 13.87	€ 14.82	€ 14.62
WT SGD H	SGD 13.90	SGD 14.84	SGD 14.60
WT USD H	\$ 13.96	\$ 14.91	\$ 14.68

Emerging Markets Debt Portfolio

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen	\$ 650,083,335	\$ 870,118,646	\$ 941,712,812
Klasse			
A	\$ 12.28	\$ 14.52	\$ 14.41
A EUR (a)	€ 10.96	€ 12.30	€ 12.08
A2	\$ 31.36	\$ 36.18	\$ 34.23
A2 CHF H	CHF 14.19	CHF 16.46	CHF 15.78
A2 EUR (a)	€ 27.96	€ 30.64	€ 28.69
A2 EUR H	€ 19.23	€ 22.31	€ 21.34
A2 HKD	HKD 245.06	HKD 281.39	N/A
A2 PLN	PLN 131.64	PLN 138.56	N/A
A2 PLN H	PLN 95.57	PLN 110.09	PLN 105.14
A2 SGD H	SGD 19.62	SGD 22.64	SGD 21.46
AA	\$ 10.22	\$ 12.19	\$ 12.27
AA AUD H	AUD 9.63	AUD 11.50	AUD 11.65
AA CAD H	CAD 9.45	CAD 11.27	CAD 11.39
AA EUR H	€ 9.59	€ 11.45	€ 11.56
AA GBP H	£ 9.42	£ 11.25	£ 11.39
AA HKD	HKD 79.88	HKD 94.81	N/A
AA NZD H	NZD 9.40	NZD 11.20	NZD 11.31
AA RMB H	CNH 71.87	CNH 85.67	CNH 86.21
AA SGD H	SGD 9.96	SGD 11.88	SGD 11.97
AA ZAR H	R 66.09	R 78.80	R 79.14
AI	\$ 61.55	\$ 74.73	N/A
AI AUD H	AUD 61.37	AUD 74.55	N/A

## Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
AR EUR	€ 10.85	€ 11.88	€ 11.85
AT	\$ 12.32	\$ 14.58	\$ 14.47
AT AUD H	AUD 10.87	AUD 12.88	AUD 12.87
AT CAD H	CAD 9.96	CAD 11.79	CAD 11.74
AT EUR (a)	€ 11.00	€ 12.35	€ 12.13
AT EUR H	€ 11.29	€ 13.38	€ 13.31
AT GBP H	£ 9.99	£ 11.83	£ 11.81
AT HKD	HKD 96.31	HKD 113.43	N/A
AT NZD H	NZD 9.74	NZD 11.52	NZD 11.48
AT RMB H	CNH 74.93	CNH 88.59	CNH 87.93
AT SGD H	SGD 10.84	SGD 12.83	SGD 12.76
B	N/A	N/A	\$ 14.41
B2	N/A	N/A	\$ 29.62
B2 EUR (a) (15)	N/A	€ 26.25	€ 24.83
B2 HKD	HKD 208.97	HKD 241.14	N/A
BA (16)	N/A	\$ 11.25	\$ 11.43
BA AUD H (17)	N/A	AUD 10.63	AUD 10.87
BA ZAR H (18)	N/A	R 72.43	R 73.48
BT	\$ 12.29	\$ 14.54	\$ 14.43
BT AUD H (19)	N/A	AUD 12.90	AUD 12.87
BT CAD H	N/A	N/A	CAD 11.74
BT EUR H	€ 11.32	€ 13.41	€ 13.33
BT GBP H	N/A	N/A	£ 11.77
BT HKD	HKD 96.09	HKD 113.12	N/A
BT NZD H	N/A	N/A	NZD 11.55
C	\$ 12.28	\$ 14.53	\$ 14.41
C EUR (a)	€ 10.96	€ 12.30	€ 12.08
C2	\$ 29.16	\$ 33.72	\$ 32.04
C2 EUR (a)	€ 26.00	€ 28.55	€ 26.86
C2 EUR H	€ 18.30	€ 21.29	€ 20.45
CT	\$ 10.43	\$ 12.34	\$ 12.25
EA	\$ 12.00	\$ 14.35	\$ 14.52
EA AUD H	AUD 11.60	AUD 13.88	AUD 14.14
EA ZAR H	R 78.76	R 94.15	R 94.99
EI	\$ 61.21	\$ 74.50	N/A
EI AUD H	AUD 61.04	AUD 74.36	N/A
I	\$ 12.28	\$ 14.53	\$ 14.42
I2	\$ 34.21	\$ 39.36	\$ 37.03
I2 CHF H	CHF 14.93	CHF 17.27	CHF 16.47
I2 EUR (a)	€ 30.51	€ 33.33	€ 31.03
I2 EUR H	€ 20.61	€ 23.84	€ 22.67
IT	N/A	N/A	\$ 12.24
IT AUD H	AUD 9.76	AUD 11.57	AUD 11.55
IT EUR H	€ 10.79	€ 12.79	€ 12.74
IT SGD H	SGD 10.14	SGD 12.01	SGD 11.94
N2	\$ 16.14	\$ 18.68	\$ 17.77
NT	\$ 10.14	\$ 11.99	\$ 11.89
S	\$ 33.86	\$ 38.83	\$ 36.28
S EUR H	€ 21.28	€ 24.53	€ 23.15
S GBP H	£ 22.59	£ 25.92	£ 24.34

	Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)		
	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
S1 2 .....	\$ 31.76	\$ 36.52	\$ 34.31
S1 2 EUR (a) .....	€ 28.33	€ 30.93	€ 28.76
S1 EUR H .....	€ 19.93	€ 23.04	€ 21.86
S1 GBP H .....	£ 21.18	£ 24.36	£ 23.01
S1QD EUR H (20) .....	N/A	€ 98.69	€ 98.17
SA .....	\$ 75.56	\$ 89.53	\$ 88.93

  

	Mortgage Income Portfolio		
	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen .....	\$ 1,087,483,094	\$ 1,493,772,913	\$ 1,322,589,619
Klasse			
A .....	\$ 11.74	\$ 12.18	\$ 12.00
A2 .....	\$ 18.14	\$ 18.33	\$ 17.03
A2 EUR (a) .....	€ 16.17	€ 15.52	€ 14.27
A2 HKD .....	HKD 141.78	HKD 142.59	N/A
A2 SGD .....	SGD 24.61	SGD 24.67	N/A
A2X .....	\$ 12.99	\$ 13.13	\$ 12.19
A2X EUR (a) .....	€ 11.59	€ 11.12	€ 10.22
AA .....	\$ 10.43	\$ 10.91	\$ 10.89
AA AUD H .....	AUD 10.08	AUD 10.55	AUD 10.58
AA HKD .....	HKD 81.54	HKD 84.83	N/A
AA RMB H .....	CNH 71.29	CNH 74.47	CNH 74.25
AA SGD H .....	SGD 10.33	SGD 10.79	SGD 10.78
AA ZAR H .....	R 69.78	R 72.79	R 72.23
AR EUR H .....	€ 10.72	€ 10.87	€ 10.88
AT .....	\$ 11.76	\$ 12.21	\$ 12.03
AT AUD H .....	AUD 11.41	AUD 11.86	AUD 11.73
AT EUR (a) .....	€ 10.50	€ 10.34	€ 10.08
AT GBP H .....	£ 12.29	£ 12.77	£ 12.62
AT HKD .....	HKD 91.94	HKD 94.97	N/A
AT SGD .....	SGD 15.96	SGD 16.43	N/A
AT SGD H .....	SGD 11.62	SGD 12.07	SGD 11.89
AX .....	\$ 5.69	\$ 5.90	\$ 5.81
AX EUR (a) .....	€ 5.07	€ 5.00	€ 4.87
B2X (21) .....	N/A	\$ 12.41	\$ 11.58
BA .....	N/A	N/A	\$ 10.14
BAAUD H .....	N/A	N/A	AUD 9.85
BA ZAR H .....	N/A	N/A	R 67.40
BX .....	\$ 5.69	\$ 5.90	\$ 5.81
BX EUR (a) .....	€ 5.07	€ 5.00	€ 4.87
C .....	\$ 11.75	\$ 12.20	\$ 12.01
C2 .....	\$ 17.47	\$ 17.69	\$ 16.51
C2 EUR .....	€ 15.58	€ 14.98	N/A
C2X (22) .....	N/A	\$ 17.53	\$ 16.35
CX .....	\$ 5.69	\$ 5.90	\$ 5.81
I .....	\$ 11.74	\$ 12.19	\$ 12.01
I EUR (a) .....	€ 10.48	€ 10.32	€ 10.07
I2 .....	\$ 18.95	\$ 19.10	\$ 17.65
I2 EUR (a) .....	€ 16.90	€ 16.17	€ 14.79
I2 EUR H .....	€ 14.76	€ 14.93	€ 13.93

## Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2022 (ungeprüft)	31. August 2021	31. August 2020
I2X .....	\$ 11.66	\$ 11.75	\$ 10.85
IT EUR H .....	€ 12.42	€ 12.89	€ 12.71
IX .....	\$ 5.69	\$ 5.90	\$ 5.81
N2 .....	\$ 15.21	\$ 15.42	\$ 14.40
NT .....	\$ 12.52	\$ 13.00	\$ 12.80
S .....	\$ 11.71	\$ 12.16	\$ 11.97
S1 .....	\$ 17.64	\$ 17.76	\$ 16.38
S1 EUR (a) .....	€ 15.73	€ 15.04	€ 13.73
S1 EUR H .....	€ 96.51	€ 97.54	€ 90.81
S1 JPY .....	¥ 10,679.00	¥ 10,291.00	¥ 9,138.00
S1X .....	\$ 5.69	\$ 5.90	\$ 5.81
SA .....	\$ 76.92	\$ 79.92	\$ 78.76

\* Der letzte NAV wurde am 28. Januar 2022 berechnet. Siehe Anmerkung A

(a) Auflegungsdatum 15. Juli 2021. Die vor der Auflegung genannte Wertentwicklung ist synthetisch

- (1) Aufgelöst am 4. Oktober 2021 mit einem abschließenden NAV von €22.45 und am 26. Oktober 2021 neu aufgelegt
- (2) Aufgelöst am 20. September 2021 mit einem abschließenden NAV von \$16.46
- (3) Auflegungsdatum 15. Februar 2022
- (4) Aufgelöst am 20. Dezember 2021 mit einem abschließenden NAV von R99.51
- (5) Aufgelöst am 20. Dezember 2021 mit einem abschließenden NAV von AUD14.88
- (6) Aufgelöst am 20. September 2021 mit einem abschließenden NAV von R113.15
- (7) Aufgelöst am 24. Januar 2022 mit einem abschließenden NAV von €12.54
- (8) Aufgelöst am 21. Januar 2022 mit einem abschließenden NAV von \$7.50
- (9) Aufgelöst am 20. Dezember 2021 mit einem abschließenden NAV von R59.76
- (10) Aufgelöst am 30. November 2021 mit einem abschließenden NAV von €12.47
- (11) Aufgelöst am 20. Dezember 2021 mit einem abschließenden NAV von R76.35
- (12) Aufgelöst am 20. September 2021 mit einem abschließenden NAV von €6.96
- (13) Aufgelöst am 31. Januar 2022 mit einem abschließenden NAV von €11.39
- (14) Aufgelöst am 22. November 2021 mit einem abschließenden NAV von \$7.64
- (15) Aufgelöst am 20. Dezember 2021 mit einem abschließenden NAV von €26.18
- (16) Aufgelöst am 20. September 2021 mit einem abschließenden NAV von \$11.16
- (17) Aufgelöst am 20. September 2021 mit einem abschließenden NAV von AUD10.54
- (18) Aufgelöst am 20. Dezember 2021 mit einem abschließenden NAV von R68.15
- (19) Aufgelöst am 31. Dezember 2021 mit einem abschließenden NAV von AUD12.15
- (20) Aufgelöst am 11. Oktober 2021 mit einem abschließenden NAV von €95.39
- (21) Aufgelöst am 24. Januar 2022 mit einem abschließenden NAV von \$12.42
- (22) Aufgelöst am 20. Oktober 2021 mit einem abschließenden NAV von \$17.57

**ANMERKUNG A: Allgemeine Informationen**

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

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

Ab Ende 2019 und auch bis 2021 weitete sich der Ausbruch des neuen Coronavirus, das eine als COVID-19 bekannte Krankheit verursacht, zu einer globalen Pandemie aus. Die zunehmenden Turbulenzen aufgrund der Ausbreitung des Coronavirus und das Potenzial für dauerhafte und erhebliche negative Auswirkungen auf die Weltwirtschaft haben zu einer erhöhten Marktvolatilität geführt, die sich im weiteren Verlauf der Pandemie und ihrer Folgen wiederholen kann.

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

Der Verwaltungsrat hat beschlossen, die Übertragung aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (die „Umstrukturierung“) des AB FCPI – Sustainable US Thematic Portfolios in das AB SICAV I – Sustainable US Thematic Portfolio zu genehmigen. Die Umstrukturierung erfolgte mit Wirkung zum 28. Januar 2022 zum Umtauschverhältnis von 1:1.

Die folgende Tabelle zeigt den Beginn der Geschäftstätigkeit der einzelnen Portefeuilles sowie die zum 28. Februar 2022 angebotenen Anteilklassen:

<b>AB FCPI-</b>	<b>Geschäftsaufnahme</b>	<b>Angebote Anteilklassen</b>
Dynamic Diversified Portfolio . . . . .	1. November 2004	A, A EUR, A EUR H, AX, AX EUR, AX SGD, BX, BX SGD, C, C EUR, C EUR H, CX, I, I EUR, I EUR H, IX & S1 EUR H
Global Equity Blend Portfolio . . . . .	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
Global Value Portfolio . . . . .	31. Mai 2006	A, A EUR, A SGD, A SGD H, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR H, AD GBP H, AD HKD, AD SGD H, AD ZAR H, B, C, C EUR, I, I EUR, I GBP, I SGD, S, S GBP, S GBP H, S1, S1 EUR, S1 GBP & SD
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 AUD H, C EUR, ED, I, I AUD H, I EUR, N, S, 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 RMB H, AD SGD H, AD ZAR H, AY JPY, BD, BD AUD H, BD CAD H, BD HKD, BD NZD H, BY JPY, C, C AUD H, C EUR, ED, I, I AUD H, I EUR, I GBP, ID, ID AUD H, S, S HKD, S1, S1 EUR & SD
Japan Strategic Value Portfolio . . . . .	14. Dezember 2005	A, A AUD H, A CZK H, A EUR, A EUR H, A NZD H, A PLN, A SGD, A SGD H, A USD, A USD H, AD, AD AUD H, AD NZD H, AD USD H, AD ZAR H, C, C EUR, C EUR H, C USD, I, I EUR, I EUR H, I SGD, I USD, I USD H, S EUR H, S1 EUR, S1 USD, S1 USD H & SD



AB FCPI-	Geschäftsaufnahme	Angeborene Anteilklassen
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 RMB H, AD SGD H, AD ZAR H, B, B EUR, BD NZD H, C, C EUR, I, I EUR, S, 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 NZD H, AA SGD H, AJ, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR, AT EUR H, AT GBP H, AT HKD, AT NZD H, AT SGD H, AX, B, C, C2, C2 EUR H, I, I EUR, I2, I2 AUD H, I2 EUR, I2 EUR H, IT, IT AUD H, N2, NT, S, S EUR H, S SGD H, S1 2, S1 2 EUR, S1 EUR H & SA
Global High Yield Portfolio . . . . .	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, BA, BA AUD H, BT, BT AUD H, BT CAD H, BT GBP H, BT HKD, BT NZD H, C, C EUR, C2, C2 EUR, C2 EUR H, CK, CK EUR H, CT, EA, EA AUD H, EA ZAR H, I, I EUR, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 EUR, I2 EUR H, I2 SGD, I2 SGD H, IA AUD H, IQD, IQD EUR, IT, IT AUD H, IT CAD H, IT EUR H, IT GBP H, IT HKD, IT NZD H, IT RMB H, J, N2, NT, S1, S1 EUR, S1D, SA, SHK, SK, W, W EUR, W2, W2 CHF H, W2 EUR H, WT, WT AUD H, WT CAD H, WT EUR H, WT GBP H & WT RMB H
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, B2 HKD, BA, BA AUD H, BT, BT AUD H, BT CAD H, BT EUR H, BT GBP H, BT HKD, BT NZD H, C, C EUR, C2, C2 DUR PH, C2 EUR, C2 EUR H, CT, EA, EA AUD H, EA ZAR H, I, I EUR, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 DUR PH, I2 EUR, I2 EUR H, I2 HKD, I2 SGD, I2 SGD H, IA, IA AUD H, IT, IT AUD H, IT CAD H, IT EUR H, IT GBP H, IT HKD, IT JPY, IT JPY H,

AB FCPI-	Geschäftsaufnahme	Angeborene Anteilklassen
American Income Portfolio (Fortsetzung) . . . . .		IT NZD H, IT RMB H, IT SGD, IT SGD H, J, L2, L2 AUD H, L2 SGD H, LT, LT AUD H, LT SGD H, N2, NT, S, S1, S1 EUR, S1D, S1D2, SA, SHK, W, W2, W2 CHF H, W2 EUR H, WT, WT AUD H, WT EUR H, WT GBP H, WT HKD & WT SGD H
European Income Portfolio . . . . .	25. Februar 1999	A, A USD, A2, A2 CHF H, A2 PLN H, A2 SGD H, A2 USD, A2 USD H, AA, AA AUD H, AA HKD H, AA RMB H, AA SGD H, AA USD H, AK, AR, AT, AT AUD H, AT SGD H, AT USD, AT USD H, B USD, B2, B2 USD, BA AUD H, BA USD H, BT, BT AUD H, BT USD H, C, C USD, C2, C2 USD, C2 USD H, CK, CT USD H, I, I USD, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 USD, I2 USD H, IA, IA HKD H, IA SGD H, IA USD H, IT, IT SGD H, IT USD H, NT USD H, S1, S1 USD, S1 USD H, S1D, SA USD H, SHK, W2, W2 CHF H, W2 USD H, WA, WA HKD H, WA USD H, WT, WT SGD H & WT USD H
Emerging Markets Debt Portfolio . . . . .	22. März 2006	A, A EUR, A2, A2 CHF H, A2 EUR, A2 EUR H, A2 HKD, A2 PLN, A2 PLN H, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA EUR H, AA GBP H, AA HKD, AA NZD H, AA RMB H, AA SGD H, AA ZAR H, AI, AI AUD H, AR EUR, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR, AT EUR H, AT GBP H, AT HKD, AT NZD H, AT RMB H, AT SGD H, B2 HKD, BT, BT EUR H, BT HKD, C, C EUR, C2, C2 EUR, C2 EUR H, CT, EA, EA AUD H, EA ZAR H, EI, EI AUD H, I, I2, I2 CHF H, I2 EUR, I2 EUR H, IT AUD H, IT EUR H, IT SGD H, N2, NT, S, S EUR H, S GBP H, S1 2, S1 2 EUR, S1 EUR H, S1 GBPH & SA
Mortgage Income Portfolio . . . . .	26. September 1994	A, A2, A2 EUR, A2 HKD, A2 SGD, A2X, A2X EUR, AA, AA AUD H, AA HKD, AA RMB H, AA SGD H, AA ZAR H, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT EUR, AT GBP H, AT HKD, AT SGD, AT SGD H, AX, AX EUR, BX, BX EUR, C, C2, C2 EUR, CX, I, I EUR, I2, I2 EUR, I2 EUR H, I2X, IT EUR H, IX, N2, NT, S, S1, S1 EUR, S1 EUR H, S1 JPY, S1X & SA

**ANMERKUNG B: Relevante Bilanzierungsgrundsätze**

Der Halbjahresabschluss wurde in Übereinstimmung mit den gesetzlichen und aufsichtsbehördlichen Bestimmungen in Luxemburg erstellt. Es folgt eine Zusammenfassung der relevanten Bilanzierungsgrundsätze der Portefeuilles.

**1. Bewertung****1.1 Anlagen in Wertpapiere**

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

der zuletzt verfügbare Kurs an der Börse bzw. dem Markt, die/der den Primärmarkt für dieses Wertpapier darstellt, zugrunde gelegt.

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

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

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

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

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

Das Japan Strategic Value Portfolio und das Asia Ex-Japan Equity Portfolio verfolgen die Politik, Wertpapiere nur dann zum Marktwert zu bewerten, wenn dies auf Basis der Wertentwicklung der Benchmark und der relativen Aktienkapitalflüsse relevant erscheint.

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

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

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

## 1.2 Bewertung von Optionsscheinen

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

## 1.3 Finanzterminkontrakte

Beim Abschluss von Finanzterminkontrakten werden Einschusszahlungen geleistet. Solange der Terminkontrakt offen ist, werden die Veränderungen des Kontraktwerts als unrealisierte Gewinne oder Verluste verbucht, indem täglich Neubewertungen vorgenommen werden, um den Marktwert

des Kontrakts am Ende jedes Handelstages widerzuspiegeln. Je nachdem, ob unrealisierte Verluste oder Gewinne erzielt werden, werden Nachschusszahlungen geleistet oder erhalten. Wenn der Kontrakt glattgestellt wird, wird ein realisierter Gewinn oder Verlust verbucht. Dieser realisierte Gewinn oder Verlust entspricht der Differenz zwischen dem Erlös (oder den Kosten) der Glattstellungstransaktion und der Basis des Fonds im Kontrakt.

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

#### 1.4 Devisentermingeschäfte

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

#### 1.5 Gekaufte und verkaufte Optionen

Wenn eine Option gekauft wird, wird ein dem bezahlten Preis entsprechender Betrag als Anlage verbucht und im Folgenden dem aktuellen Marktwert der gekauften Option angepasst. Der Preis, der für den Kauf von Optionen bezahlt wurde, die verfallen, ohne ausgeübt zu werden, wird am Verfallsdatum als realisierter Verlust verbucht. Wenn eine gekaufte Verkaufsoption ausgeübt wird, wird der Optionspreis vom Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung abgezogen, um festzustellen, ob das jeweilige Portefeuille einen Gewinn oder Verlust realisiert hat. Wenn eine gekaufte Kaufoption ausgeübt wird, erhöht der Optionspreis die Kostenbasis des Wertpapiers oder der vom jeweiligen Portefeuille gekauften Fremdwährung. Wenn eine Option verkauft wird, wird ein dem erhaltenen Preis entsprechender Betrag als Verbindlichkeit verbucht und im Folgenden dem aktuellen Marktwert der verkauften Option angepasst. Der Preis, der für verkaufte Optionen erhalten wird, die verfallen, ohne ausgeübt zu werden, wird vom jeweiligen Portefeuille am Verfallsdatum als realisierter Gewinn verbucht. Wenn eine verkaufte Kaufoption ausgeübt wird, wird der Preis zum Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der 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, Devisenterminkontrakten, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ verbucht. Schwankungen des Werts von Swap-Kontrakten werden als eine Komponente der „Änderung der unrealisierten 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 wurden folgende Kurse zugrunde gelegt: Kassakurs von 1.1213 und Mittelkurs von 1.1457 für die Umrechnung von EUR in USD, Kassakurs von 0.0087 und Mittelkurs von 0.0088 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 Transaktionstag 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, des Global Value Portfolio und Short Duration Bond Portfolio)

Die Verwaltungsgesellschaft hat allen Anteilhabern des Fonds mitgeteilt, dass mit Wirkung vom 2. November 2015 eine

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

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

Der in den statistischen Informationen offengelegte NAV je Anteil und das Gesamtnettovermögen sind der veröffentlichte NAV je Anteil und das Gesamtnettovermögen, wohingegen das in der Zusammensetzung des Fondsvermögens sowie in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens ausgewiesene Gesamtnettovermögen der Gesamt-NAV ohne Swing-Anpassungen zum Ende eines Berichtszeitraums ist.

Alle Swing Pricing unterliegenden Portefeuilles passten ihren NAV während des Berichtszeitraums an. Zum 28. Februar 2022 passte keines der Portefeuilles seinen NAV an.

##### ANMERKUNG C: Steuern

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

sind, wie gemäß Artikel 174 des Gesetzes von 2010 definiert. Auf Zinsen, Dividenden und Kursgewinne aus Wertpapieren werden unter Umständen in gewissen Ländern Quellen- oder Kapitalertragsteuern erhoben.

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

**ANMERKUNG D: Ausschüttungen**

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

Für das Dynamic Diversified Portfolio:

- Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Ausschüttungen können aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. 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.
- Für Anteile der Klasse 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 Global Value Portfolio:

- Für Anteile der Klasse A, B, C, I, S, S1, SA GB, SB GB, S1A GB und S1B GB (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klasse 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 Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigte, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen worden sein. 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.

Für das Emerging Markets Growth Portfolio:

- Für Anteile der Klasse A, B, C, I, N, S, S1 und S1BR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen

Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

- Für Anteile der Klasse 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 Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und 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.

Für das Sustainable US Thematic Portfolio:

- Für Anteile der Klasse A, AN, B, C, E, I, IN, S, S1, S1A GB und S1B GB (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigte die Verwaltungsgesellschaft nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde wurden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV der Anteile wiedergegeben.
- Für Anteile der Klasse INN und S1NN beabsichtigte die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klasse AD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigte die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigte, eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil für diese Anteilklassen beizubehalten. Daher können Ausschüttungen aus den der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Bruttoerträgen (vor der Reduzierung um Gebühren und Aufwendungen), realisierten und nicht realisierten Gewinnen und aus deren Kapital stammen. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers dargestellt und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduziert haben.

Für das Asia Ex-Japan Equity Portfolio:

- Für Anteile der Klasse 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 Klasse 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 Klasse AD, BD, ED, ID und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklä-

ren und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und 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.

Für das Japan Strategic Value Portfolio:

- Für Anteile der Klasse 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 Klasse 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 Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und 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.

Für das China Low Volatility Equity Portfolio:

- Für Anteile der Klasse 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 Klasse AD und BD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und 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.

Für das Short Duration Bond Portfolio:

- Für Anteile der Klasse A, AX, B, C, I, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H, sofern nicht anders angegeben) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Divi-

denen 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 Klasse AJ, AT, BT, CT, IT und NT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klasse 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 Klasse A2, B2, C2, I2, N2, S2 und S1 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) und Anteile der Klassen S EUR H, S1 EUR H und 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 Klasse 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 Klasse 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 Klasse 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 Klasse AK und CK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsge-

sellschaft, 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 Klasse AA, BA, EA, IA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klassen SHK und SQ beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, die Ausschüttungen täglich zu erklären und monatlich vorzunehmen. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
- Für Anteile der Klasse A2, B2, C2, I2, N2, S, S1, S1BR 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 American Income Portfolio:

- Für Anteile der Klasse 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 Klasse AT, BT, CT, IT, LT, NT, S1D, S1D2 und WT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H und Klasse DUR PH) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klasse AK und CK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden zweimal jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klasse AA, BA, EA, IA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H und Klasse DUR PH) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klasse SHK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, die Ausschüttun-

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

- Für Anteile der Klasse S1QD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klasse A2, B2, C2, I2, L2, N2, S, S1, S1BR 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 widerspiegelt.

Für das European Income Portfolio:

- Für Anteile der Klasse A, B, C und I beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klasse AT, BT, CT, IT, NT, S1D und WT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klasse AK und CK beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden zweimal jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klasse AA, BA, 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 jähr-



lich 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 A2, B2, C2, 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 widergespiegelt.

Für das Emerging Markets Debt Portfolio:

- Für Anteile der Klasse A, B, C und I (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klasse 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 Klasse 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 Klasse 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 Klasse A2, B2, C2, I2, N2, S, S1, S1BR und S1 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

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

Für das Mortgage Income Portfolio:

- Für Anteile der Klasse 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 Klasse 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 Klasse 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 Klasse A2, A2X, B2X, C2, C2X, I2, I2X, N2, S1, S2 und S1BR (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 Verwaltungsgebühr. Gemäß den Bedingungen des Anlageverwaltungsvertrags zahlt die Verwaltungsgesellschaft AllianceBernstein L.P. (der „Anlageverwalter“) aus der erhaltenen Verwaltungsgebühr eine Anlageverwaltungsgebühr.

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

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

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Dynamic Diversified		
Portfolio . . . . .	Klasse A	1.95%
	Klasse A EUR	1.95%
	Klasse A EUR H	1.95%
	Klasse AX	1.90%
	Klasse AX EUR	1.90%
	Klasse AX SGD	1.90%
	Klasse BX	2.90%
	Klasse BX SGD	2.90%
	Klasse C	2.25%
	Klasse C EUR	2.25%
	Klasse C EUR H	2.25%
	Klasse CX	2.20%
	Klasse I	1.25%
	Klasse I EUR	1.25%
	Klasse I EUR H	1.25%
	Klasse IX	1.20%
	Klasse S1 EUR H	0.80%
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	%
Global Value Portfolio . . . . .	Klasse S	0.12%
	Klasse S GBP	0.12%
	Klasse S GBPH	0.12%
	Klasse S1	0.82%
	Klasse S1 EUR	0.82%
	Klasse S1 GBP	0.82%
	Klasse SD	0.12%
Emerging Markets Growth		
Portfolio . . . . .	Klasse S	0.30%
	Klasse S1	1.20%
	Klasse S1 EUR	1.20%
	Klasse S1 GBP	1.20%
Sustainable US Thematic		
Portfolio(a). . . . .	Klasse A	1.75%
	Klasse A AUD H	1.75%
	Klasse A CAD H	1.75%
	Klasse A EUR	1.75%
	Klasse A EUR H	1.75%
	Klasse A GBPH	1.75%
	Klasse A HKD	1.75%
	Klasse A SGD H	1.75%
	Klasse AN	1.75%
	Klasse B	2.75%
	Klasse C	2.20%
	Klasse C EUR	2.20%
	Klasse C EUR H	2.20%
	Klasse C SGD	2.20%
	Klasse E	2.75%
	Klasse I	0.95%
	Klasse I EUR	0.95%
	Klasse I EUR H	0.95%
	Klasse I GBP	0.95%
	Klasse IN	0.95%
	Klasse IN EUR	0.95%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.80%
	Klasse S1 EUR	0.80%
	Klasse S1 JPY H	0.80%
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%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
Asia Ex-Japan Equity			Japan Strategic Value		
Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse AD EUR H	2.05%	Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse I EUR H	0.90%(d)
	Klasse AD GBP H	2.05%		Klasse I SGD	0.90%(d)
	Klasse AD HKD	2.05%		Klasse I USD	0.90%(d)
	Klasse AD NZD H	2.05%		Klasse I USD H	0.90%(d)
	Klasse AD RMB H	2.05%		Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse AD SGD H	2.05%		Klasse S1 EUR	0.80%
	Klasse AD ZAR H	2.05%		Klasse S1 USD	0.80%
	Klasse AY JPY	2.05%		Klasse S1 USD H	0.80%
	Klasse BD	3.05%		Klasse SD	0.15%
	Klasse BD AUD H	3.05%	China Low Volatility Equity		
	Klasse BD CAD H	3.05%	Portfolio . . . . .	Klasse A	1.99%
	Klasse BD HKD	3.05%		Klasse A EUR	1.99%
	Klasse BD NZD H	3.05%		Klasse A HKD	1.99%
	Klasse BD ZAR H(b)	3.05%		Klasse A PLN H	1.99%
	Klasse BY JPY	2.52%		Klasse AD	1.99%
	Klasse C	2.50%		Klasse AD AUD H	1.99%
	Klasse C AUD H	2.50%		Klasse AD CAD H	1.99%
	Klasse C EUR	2.50%		Klasse AD EUR H	1.99%
	Klasse ED	3.05%		Klasse AD GBP H	1.99%
	Klasse I	1.25%		Klasse AD HKD	1.99%
	Klasse I AUD H	1.25%		Klasse AD NZD H	1.99%
	Klasse I EUR	1.25%		Klasse AD RMB H	1.99%
	Klasse I GBP	1.25%		Klasse AD SGD H	1.99%
	Klasse ID	1.25%		Klasse AD ZAR H	1.99%
	Klasse ID AUD H	1.25%		Klasse B	2.99%
	Klasse S	0.30%		Klasse B EUR	2.99%
	Klasse S HKD	0.30%		Klasse BD NZD H	2.99%
	Klasse S1	1.20%		Klasse BD ZAR H(e)	2.99%
	Klasse S1 EUR	1.20%		Klasse C	2.44%
	Klasse SD	0.30%		Klasse C EUR	2.44%
Japan Strategic Value				Klasse I	1.19%
Portfolio . . . . .	Klasse A	1.70%(c)		Klasse I EUR	1.19%
	Klasse A AUD H	1.70%(c)		Klasse S	0.16%
	Klasse A CZK H	1.70%(c)		Klasse S1	0.91%
	Klasse A EUR	1.70%(c)		Klasse S1 EUR	0.91%
	Klasse A EUR H	1.70%(c)	Short Duration Bond		
	Klasse A NZD H	1.70%(c)	Portfolio . . . . .	Klasse A	1.20%
	Klasse A PLN	1.70%(c)		Klasse A EUR	1.20%
	Klasse A SGD	1.70%(c)		Klasse A2	1.20%
	Klasse A SGD H	1.70%(c)		Klasse A2 EUR	1.20%
	Klasse A USD	1.70%(c)		Klasse A2 EUR H	1.20%
	Klasse A USD H	1.70%(c)		Klasse A2 HKD	1.20%
	Klasse AD	1.70%(c)		Klasse A2 SGD H	1.20%
	Klasse AD AUD H	1.70%(c)		Klasse AA	1.20%
	Klasse AD NZD H	1.70%(c)		Klasse AA AUD H	1.20%
	Klasse AD USD H	1.70%(c)		Klasse AA CAD H	1.20%
	Klasse AD ZAR H	1.70%(c)		Klasse AA GBP H	1.20%
	Klasse BD AUD H(b)	3.15%		Klasse AA HKD	1.20%
	Klasse C	2.60%		Klasse AA NZD H	1.20%
	Klasse C EUR	2.60%		Klasse AA SGD H	1.20%
	Klasse C EUR H	2.60%		Klasse AJ	1.00%
	Klasse C USD	2.60%		Klasse AR EUR H	1.20%
	Klasse I	0.90%(d)		Klasse AT	1.20%
	Klasse I EUR	0.90%(d)		Klasse AT AUD H	1.20%
			AB FCPI-	Anteilklasse	%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
Short Duration Bond			American Income		
Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse AT CAD H	1.20%	Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse AA EUR H	1.50%
	Klasse AT EUR	1.20%		Klasse AA GBP H	1.50%
	Klasse AT EUR H	1.20%		Klasse AA HKD	1.50%
	Klasse AT GBP H	1.20%		Klasse AA NZD H	1.50%
	Klasse AT HKD	1.20%		Klasse AA RMB H	1.50%
	Klasse AT NZD H	1.20%		Klasse AA SGD H	1.50%
	Klasse AT SGD H	1.20%		Klasse AA ZAR H	1.50%
	Klasse AX	1.00%		Klasse AK	1.50%
	Klasse B	2.20%		Klasse AK EUR	1.50%
	Klasse B2 EUR(f)	2.20%		Klasse AK EUR H	1.50%
	Klasse BT(g)	2.20%		Klasse AR EUR	1.50%
	Klasse C	1.60%		Klasse AR EUR H	1.50%
	Klasse C2	1.60%		Klasse AT	1.50%
	Klasse C2 EUR H	1.60%		Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse I	0.575%		Klasse AT CAD H	1.50%
	Klasse I EUR	0.575%		Klasse AT DUR PH	1.50%
	Klasse I2	0.575%		Klasse AT EUR	1.50%
	Klasse I2 AUD H	0.575%		Klasse AT EUR H	1.50%
	Klasse I2 EUR	0.575%		Klasse AT GBP H	1.50%
	Klasse I2 EUR H	0.575%		Klasse AT HKD	1.50%
	Klasse IT	0.575%		Klasse AT NZD H	1.50%
	Klasse IT AUD H	0.575%		Klasse AT RMB H	1.50%
	Klasse N2	1.70%		Klasse AT SGD	1.50%
	Klasse NT	1.70%		Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse S	0.10%		Klasse B	2.20%
	Klasse S EUR H	0.10%		Klasse B2	2.20%
	Klasse S SGD H	0.10%		Klasse B2 HKD	2.20%
	Klasse S1 2	0.35%		Klasse BA	2.20%
	Klasse S1 2 EUR	0.35%		Klasse BA AUD H	2.20%
	Klasse S1 EUR H	0.35%		Klasse BA ZAR H(b)	2.20%
	Klasse SA	0.10%		Klasse BT	2.20%
Global High Yield				Klasse BT AUD H	2.20%
Portfolio . . . . .	Klasse S1	1.00%		Klasse BT CAD H	2.20%
	Klasse S1 EUR	1.00%		Klasse BT EUR(e)	2.20%
	Klasse S1D	1.00%		Klasse BT EUR H	2.20%
	Klasse SA	0.10%		Klasse BT GBP H	2.20%
	Klasse SHK	0.10%		Klasse BT HKD	2.20%
	Klasse SK	0.75%		Klasse BT NZD H	2.20%
American Income				Klasse C	1.95%
Portfolio . . . . .	Klasse A	1.50%		Klasse C EUR	1.95%
	Klasse A EUR	1.50%		Klasse C2	1.95%
	Klasse A2	1.50%		Klasse C2 DUR PH	1.95%
	Klasse A2 CHF H	1.50%		Klasse C2 EUR	1.95%
	Klasse A2 DUR PH	1.50%		Klasse C2 EUR H	1.95%
	Klasse A2 EUR	1.50%		Klasse CT	1.95%
	Klasse A2 EUR H	1.50%		Klasse EA	2.00%
	Klasse A2 HKD	1.50%		Klasse EA AUD H	2.00%
	Klasse A2 PLN H	1.50%		Klasse EA ZAR H	2.00%
	Klasse A2 SGD	1.50%		Klasse I	0.95%
	Klasse A2 SGD H	1.50%		Klasse I EUR	0.95%
	Klasse AA	1.50%		Klasse I2	0.95%
	Klasse AA AUD H	1.50%		Klasse I2 AUD H	0.95%
	Klasse AA CAD H	1.50%		Klasse I2 CHF H	0.95%
	Klasse AA DUR PH	1.50%		Klasse I2 DUR PH	0.95%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
American Income		
Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse I2 EUR	0.95%
	Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse I2 HKD	0.95%
	Klasse I2 SGD	0.95%
	Klasse I2 SGD H	0.95%
	Klasse IA	0.95%
	Klasse IA AUD H	0.95%
	Klasse IT	0.95%
	Klasse IT AUD H	0.95%
	Klasse IT CAD H	0.95%
	Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse IT GBP H	0.95%
	Klasse IT HKD	0.95%
	Klasse IT JPY	0.95%
	Klasse IT JPY H	0.95%
	Klasse IT NZD H	0.95%
	Klasse IT RMB H	0.95%
	Klasse IT SGD	0.95%
	Klasse IT SGD H	0.95%
	Klasse L2	1.05%
	Klasse L2 AUD H	1.05%
	Klasse L2 SGD H	1.05%
	Klasse LT	1.05%
	Klasse LT AUD H	1.05%
	Klasse LT SGD H	1.05%
	Klasse N2	2.05%
	Klasse NT	2.05%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.65%
	Klasse S1 EUR	0.65%
	Klasse S1D	0.65%
	Klasse S1D2	0.65%
	Klasse SA	0.15%
	Klasse SHK	0.15%
	Klasse W	0.95%
	Klasse W2	0.95%
	Klasse W2 CHF H	0.95%
	Klasse W2 EUR H	0.95%
	Klasse WT	0.95%
	Klasse WT AUD H	0.95%
	Klasse WT EUR H	0.95%
	Klasse WT GBP H	0.95%
	Klasse WT HKD	0.95%
	Klasse WT SGD H	0.95%
European Income		
Portfolio . . . . .	Klasse A	1.41%
	Klasse A USD	1.41%
	Klasse A2	1.41%
	Klasse A2 CHF H	1.41%
	Klasse A2 PLN H	1.41%
	Klasse A2 SGD H	1.41%
	Klasse A2 USD	1.41%
	Klasse A2 USD H	1.41%
	Klasse AA	1.41%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
European Income		
Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse AA AUD H	1.41%
	Klasse AA HKD H	1.41%
	Klasse AA RMB H	1.41%
	Klasse AA SGD H	1.41%
	Klasse AA USD H	1.41%
	Klasse AK	1.41%
	Klasse AR	1.41%
	Klasse AT	1.41%
	Klasse AT AUD H	1.41%
	Klasse AT SGD H	1.41%
	Klasse AT USD	1.41%
	Klasse AT USD H	1.41%
	Klasse B USD	2.11%
	Klasse B2	2.11%
	Klasse B2 USD	2.11%
	Klasse BA(h)	2.11%
	Klasse BA AUD H	2.11%
	Klasse BA USD H	2.11%
	Klasse BT	2.11%
	Klasse BT AUD H	2.11%
	Klasse BT USD(i)	2.11%
	Klasse BT USD H	2.11%
	Klasse C	1.86%
	Klasse C USD	1.86%
	Klasse C2	1.86%
	Klasse C2 USD	1.86%
	Klasse C2 USD H	1.86%
	Klasse CK	1.86%
	Klasse CT USD H	1.86%
	Klasse I	0.86%
	Klasse I USD	0.86%
	Klasse I2	0.86%
	Klasse I2 AUD H	0.86%
	Klasse I2 CHF H	0.86%
	Klasse I2 USD	0.86%
	Klasse I2 USD H	0.86%
	Klasse IA	0.86%
	Klasse IA HKD H	0.86%
	Klasse IA SGD H	0.86%
	Klasse IA USD H	0.86%
	Klasse IT	0.86%
	Klasse IT SGD H	0.86%
	Klasse IT USD H	0.86%
	Klasse NT USD H	1.96%
	Klasse S1	0.65%
	Klasse S1 USD	0.65%
	Klasse S1 USD H	0.65%
	Klasse S1D	0.65%
	Klasse SA USD H	0.15%
	Klasse SHK	0.15%
	Klasse W2	0.86%
	Klasse W2 CHF H	0.86%
	Klasse W2 USD H	0.86%
	Klasse WA	0.86%
	Klasse WA HKD H	0.86%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
European Income			Emerging Markets Debt		
Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse WA USD H	0.86%	Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse EA ZAR H	2.00%
	Klasse WT	0.86%		Klasse EI	2.00%
	Klasse WT SGD H	0.86%		Klasse EI AUD H	2.00%
	Klasse WT USD H	0.86%		Klasse I	0.95%
Emerging Markets Debt				Klasse I2	0.95%
Portfolio . . . . .	Klasse A	1.50%		Klasse I2 CHF H	0.95%
	Klasse A EUR	1.50%		Klasse I2 EUR	0.95%
	Klasse A2	1.50%		Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse A2 CHF H	1.50%		Klasse IT AUD H	0.95%
	Klasse A2 EUR	1.50%		Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse A2 EUR H	1.50%		Klasse IT SGD H	0.95%
	Klasse A2 HKD	1.50%		Klasse N2	2.05%
	Klasse A2 PLN	1.50%		Klasse NT	2.05%
	Klasse A2 PLN H	1.50%		Klasse S	0.15%
	Klasse A2 SGD H	1.50%		Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse AA	1.50%		Klasse S GBP H	0.15%
	Klasse AA AUD H	1.50%		Klasse S1 2	0.70%
	Klasse AA CAD H	1.50%		Klasse S1 2 EUR	0.70%
	Klasse AA EUR H	1.50%		Klasse S1 EUR H	0.70%
	Klasse AA GBP H	1.50%		Klasse S1 GBP H	0.70%
	Klasse AA HKD	1.50%		Klasse S1QD EUR H(k)	0.70%
	Klasse AA NZD H	1.50%		Klasse SA	0.15%
	Klasse AA RMB H	1.50%	Mortgage Income		
	Klasse AA SGD H	1.50%	Portfolio . . . . .	Klasse A	1.50%
	Klasse AA ZAR H	1.50%		Klasse A2	1.50%
	Klasse AI	1.50%		Klasse A2 EUR	1.50%
	Klasse AI AUD H	1.50%		Klasse A2 HKD	1.50%
	Klasse AR EUR	1.50%		Klasse A2 SGD	1.50%
	Klasse AT	1.50%		Klasse A2X	1.25%
	Klasse AT AUD H	1.50%		Klasse A2X EUR	1.25%
	Klasse AT CAD H	1.50%		Klasse AA	1.50%
	Klasse AT EUR	1.50%		Klasse AA AUD H	1.50%
	Klasse AT EUR H	1.50%		Klasse AA HKD	1.50%
	Klasse AT GBP H	1.50%		Klasse AA RMB H	1.50%
	Klasse AT HKD	1.50%		Klasse AA SGD H	1.50%
	Klasse AT NZD H	1.50%		Klasse AA ZAR H	1.50%
	Klasse AT RMB H	1.50%		Klasse AR EUR H	1.50%
	Klasse AT SGD H	1.50%		Klasse AT	1.50%
	Klasse B2 EUR(b)	2.50%		Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse B2 HKD	2.50%		Klasse AT EUR	1.50%
	Klasse BA(e)	2.50%		Klasse AT GBP H	1.50%
	Klasse BA AUD H(e)	2.50%		Klasse AT HKD	1.50%
	Klasse BA ZAR H(b)	2.50%		Klasse AT SGD	1.50%
	Klasse BT	2.50%		Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse BT AUD H(j)	2.50%		Klasse AX	1.25%
	Klasse BT EUR H	2.50%		Klasse AX EUR	1.25%
	Klasse BT HKD	2.50%		Klasse B2X(f)	1.70%
	Klasse C	1.95%		Klasse BX	1.70%
	Klasse C EUR	1.95%		Klasse BX EUR	1.70%
	Klasse C2	1.95%		Klasse C	1.95%
	Klasse C2 EUR	1.95%		Klasse C2	1.95%
	Klasse C2 EUR H	1.95%		Klasse C2 EUR	1.95%
	Klasse CT	1.95%		Klasse C2X(l)	1.70%
	Klasse EA	2.00%		Klasse CX	1.70%
	Klasse EA AUD H	2.00%		Klasse I	0.95%
				Klasse I EUR	0.95%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Mortgage Income		
Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse I2	0.95%
	Klasse I2 EUR	0.95%
	Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse I2X	0.70%
	Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse IX	0.70%
	Klasse N2	2.05%
	Klasse NT	2.05%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.65%
	Klasse S1 EUR	0.65%
	Klasse S1 EUR H	0.65%
	Klasse S1 JPY	0.65%
	Klasse S1X	0.55%
	Klasse SA	0.15%

- (a) Der letzte NAV wurde am 28. Januar 2022 berechnet. Siehe Anmerkung A.
- (b) Die Anteilklasse wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.
- (c) Wurde während des Berichtszeitraums mit Wirkung vom 15. Februar 2022 von 2.15% zu 1.70% geändert.
- (d) Wurde während des Berichtszeitraums mit Wirkung vom 15. Februar 2022 von 1.35% zu 0.90% geändert.
- (e) Die Anteilklasse wurde am 20. September 2021 aufgelöst.
- (f) Die Anteilklasse wurde am 24. Januar 2022 aufgelöst.
- (g) Die Anteilklasse wurde am 21. Januar 2022 aufgelöst.
- (h) Die Anteilklasse wurde am 31. Januar 2022 aufgelöst.
- (i) Die Anteilklasse wurde am 22. November 2021 aufgelöst.
- (j) Die Anteilklasse wurde am 31. Dezember 2021 aufgelöst.
- (k) Die Anteilklasse wurde am 11. Oktober 2021 aufgelöst.
- (l) Die Anteilklasse wurde am 20. Oktober 2021 aufgelöst.

Folgende Tabelle gibt Aufschluss über die von der Verwaltungsgesellschaft getragenen Aufwendungen während des Berichtszeitraums zum 28. Februar 2022 und die Forderungen aus Aufwandsersatzung zum 28. Februar 2022:

AB FCPI -	Getragene Aufwendungen	Forderungen aus Aufwandsersatzung
Dynamic Diversified Portfolio . . .	\$ 158,127	19,364
Global Equity Blend Portfolio . . .	\$ 45,265	4,715
Japan Strategic Value Portfolio . .	¥ 23,685,852	4,838,759
China Low Volatility Equity		
Portfolio . . . . .	\$ 28,240	6,478
Short Duration Bond Portfolio . . .	\$ 49,084	9,747
American Income Portfolio . . . . .	\$ 120	17
Mortgage Income Portfolio . . . . .	\$ 357	166

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

Der Fonds zahlt der Verwaltungsgesellschaft außerdem eine Verwaltungsgesellschaftsgebühr.

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

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

Die Jahressätze der betreffenden Gebühren für die einzelnen Portefeuilles sind in Tabelle 1 (auf Seite 198 bis 211) 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 28. Februar 2022 belief sich dieser Betrag auf \$12,845,381.

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 28. Februar 2022 belief sich dieser Betrag auf \$443,439. Der Betrag ist in der Gebühr für professionelle Dienstleistungen in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens enthalten.

Der Fonds vergütet seinem Rechtsberater Elvinger Hoss Prussen, *société anonyme* (bei dem Yves Prussen, ein Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft, Partner ist) gegenüber dem Fonds erbrachte Rechtsdienste. Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2022 wurde eine Vergütung in Höhe von €7,979 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 28. Februar 2022 wurden keine Provisionen für Wertpapiertransaktionen unter Beanspruchung der Dienste der Tochtergesellschaften, Sanford C. Bernstein & Co., LLC and Bernstein Autonomous LLP., gezahlt. Mehrere Verwaltungsratsmitglieder des Fonds sind Mitarbeiter und/oder leitende Angestellte des Anlageverwalters und/oder seiner verbundenen Unternehmen.

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

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

#### ANMERKUNG F: Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen und Transaktionskosten

Im Berichtszeitraum zum 28. Februar 2022 haben der Anlageverwalter und eventuelle verbundene Untermanager, 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 Limited delegiert, alle Kosten im Zusammenhang mit Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen „entflochten“ und vom Anlageverwalter oder seinen Untermanagern 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.

#### 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.

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

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

In der folgenden Tabelle sind die Transaktionskosten, die für die einzelnen Portefeuilles im Berichtszeitraum zum 28. Februar 2022 angefallen sind, aufgeführt:

AB FCPI-	Transaktionskosten
Dynamic Diversified Portfolio . . . . .	\$ 7,608
Global Equity Blend Portfolio . . . . .	\$ 59,301
Global Value Portfolio . . . . .	\$ 530,257
Emerging Markets Growth Portfolio . . . . .	\$ 605,532
Sustainable US Thematic Portfolio(a) . . . . .	\$ 81,471
Asia Ex-Japan Equity Portfolio . . . . .	\$ 604,846
Japan Strategic Value Portfolio . . . . .	¥ 3,582,897
China Low Volatility Equity Portfolio . . . . .	\$ 154,674
Short Duration Bond Portfolio . . . . .	\$ 10,766
Global High Yield Portfolio . . . . .	\$ 72,005
American Income Portfolio . . . . .	\$ -0-
European Income Portfolio . . . . .	€ 13,655
Emerging Markets Debt Portfolio . . . . .	\$ 2,151
Mortgage Income Portfolio . . . . .	\$ -0-

(a) Der letzte NAV wurde am 28. Januar 2022 berechnet. Siehe Anmerkung A.

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

Eine oder mehrere der Anteilklassen eines Portefeuilles, die in einer bestimmten Währung angeboten werden (jeweils eine „angebotene Währung“), können gegen diese angebotene Währung abgesichert sein. Jede solche Anteilklasse stellt eine „währungsabgesicherte Anteilklasse“ dar. Währungsab-



gesicherte 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 28. Februar 2022 gab es keine Pensionsgeschäfte.

Während des Berichtszeitraums zum 28. Februar 2022 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

zurückerlangen 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 28. Februar 2022 bestanden keine umgekehrten Pensionsgeschäfte.

Während des Berichtszeitraums 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 gegenseitige Vereinbarung, bei der beide Parteien dem Austausch einer Reihe von fest- oder variabel verzinslichen Zahlungen zustimmen, die auf Basis eines Nominalbetrags berechnet werden.

**Total-Return-Swaps**

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

**Credit-Default-Swaps**

Bei einer Credit-Default-Swap-Vereinbarung ist der Käufer verpflichtet, dem Verkäufer über die Laufzeit der Vereinbarung

hinweg regelmäßige Zahlungen zu leisten, wofür er im Gegenzug eine bedingte Zahlung erhält, falls ein Kreditereignis in Bezug auf eine zugrunde liegende Referenz-Obligation eintritt.

**Zinsswaps**

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

**Inflationsswap**

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

**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.

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 Gesamrendite eines bestimmten Vermögenswertes, eines Referenzsatzes oder eines Index. Eine Payer Swaption gibt dem Erwerber das Recht auf Zahlung der Gesamrendite 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 28. Februar 2022 für bestimmte derivative Finanzinstrumente vom Broker gehalten wurden bzw. diesem zu entrichten waren:

AB FCPI –	Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker zu entrichtende Barmittel
Dynamic Diversified Portfolio		
Morgan Stanley	\$ 425,450	61,829
Global Equity Blend Portfolio		
Bank of America	\$ 8,154	–
Barclays	\$ 7,806	–
Citibank	\$ –	13,986
JPMorgan Chase	\$ –	8,524

AB FCPI –	Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker zu entrichtende Barmittel
Short Duration Bond Portfolio		
Citibank	\$ 549,661	43,941
Morgan Stanley	\$ 2,264,000	1,244,291
Global High Yield Portfolio		
Citibank	\$ 11,397,780	–
JPMorgan Chase	\$ 51,481,000	–
Morgan Stanley	\$ 34,982,458	152,168,991
American Income Portfolio		
Citibank	\$ 47,990,000	65,037,211
Credit Suisse	\$ 2,960,000	–

AB FCPI –	Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker zu entrichtende Barmittel
<b>American Income Portfolio</b>		
(Fortsetzung)		
Deutsche Bank	\$ –	10,089,099
Goldman Sachs	\$ 3,310,000	–
JPMorgan Chase	\$112,279,000	–
Morgan Stanley	\$ 48,536,923	–
<b>European Income Portfolio</b>		
Goldman Sachs	€ 20,020,384	875,640
<b>Emerging Markets Debt Portfolio</b>		
Goldman Sachs	\$ 1,275,330	–
Morgan Stanley	\$ 2,200,505	3,773,946
<b>Mortgage Income Portfolio</b>		
Citibank	\$ 4,106,706	–
Credit Suisse	\$ 1,811,400	–
Goldman Sachs	\$ 727,000	–
JPMorgan Chase	\$ 5,377,000	–
Morgan Stanley	\$ –	42

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 28. Februar 2022 von den einzelnen Portefeuilles gehaltenen Derivate sind in der folgenden Tabelle aus Wertpapieren bestehende Sicherheiten aufgeführt:

AB FCPI –	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten
<b>Global Equity Blend Portfolio . . .</b>		
Bank of America		
U.S. Treasury Bills, 0.00%, 07/14/2022	\$ –	19,981
U.S. Treasury Notes, 0.13%, 05/31/2022	\$ –	9,159
<b>Global Value Portfolio . . . . .</b>		
Bank of America		
U.S. Treasury Bills, 0.00%, 07/14/2022	\$ –	268,433
U.S. Treasury Notes, 0.13%, 05/31/2022	\$ –	123,038
<b>Global High Yield Portfolio . . .</b>		
Bank of America		
U.S. Treasury Bills, 0.00%, 07/14/2022	\$ –	160,275
Barclays		
U.S. Treasury Bills, 0.00%, 07/14/2022	\$ –	914,644

AB FCPI –	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten
<b>Global High Yield Portfolio</b>		
(Fortsetzung) . . . . .		
Citibank		
U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 55,166,901	–
U.S. Treasury Notes, 1.13%, 02/15/2031	\$ 88,615,372	–
U.S. Treasury Notes, 1.38%, 10/31/2028	\$ 2,228,509	–
Credit Suisse		
U.S. Treasury Bonds, 6.25%, 05/15/2030	\$ 35,875,852	–
Deutsche Bank		
U.S. Treasury Bonds, 6.25%, 05/15/2030	\$ 7,213,499	–
Goldman Sachs		
U.S. Treasury Bonds, 1.38%, 08/15/2050	\$ 101,995,770	–
U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 104,218,399	–
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 15,435,054	–
U.S. Treasury Bonds, 6.25%, 05/15/2030	\$ 5,190,766	–
U.S. Treasury Notes, 0.38%, 04/30/2025	\$ 1,264,676	–
Morgan Stanley		
U.S. Treasury Bonds, 1.38%, 08/15/2050	\$ 11,026,886	–
U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 452,937	–
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 48,029,497	–
U.S. Treasury Bonds, 6.25%, 05/15/2030	\$ 2,598,058	–
U.S. Treasury Bonds, 6.75%, 08/15/2026	\$ 258,231,381	–
U.S. Treasury Notes, 1.13%, 02/15/2031	\$ 690,173	–
U.S. Treasury Notes, 1.38%, 10/31/2028	\$ 1,546,156	–
Standard Chartered Bank		
U.S. Treasury Notes, 0.38%, 04/30/2025	\$ 769	–
<b>American Income Portfolio . . .</b>		
Bank of America		
U.S. Treasury Notes, 0.88%, 06/30/2026	\$ 1,042,995	–
U.S. Treasury Notes, 2.25%, 11/15/2024	\$ 1,538,053	–
Barclays		
U.S. Treasury Notes, 0.88%, 06/30/2026	\$ 7,951,334	–

AB FCPI –	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten
American Income		
Portfolio (Fortsetzung) . . . . .		
U.S. Treasury Notes, 2.25%, 11/15/2024	\$ 364,876	–
Citibank		
U.S. Treasury Notes, 0.88%, 06/30/2026	\$ 200,775,713	–
U.S. Treasury Notes, 2.25%, 11/15/2024	\$ 64,102,500	–
Credit Suisse		
U.S. Treasury Notes, 2.25%, 11/15/2024	\$ 13,188,326	–
Goldman Sachs		
U.S. Treasury Notes, 0.50%, 10/31/2027	\$ 7,608,406	–

AB FCPI –	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten
American Income		
Portfolio (Fortsetzung) . . . . .		
U.S. Treasury Notes, 0.88%, 06/30/2026	\$ 120,447,995	–
Morgan Stanley		
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 08/15/2029	\$ 468,450	–
U.S. Treasury Notes, 0.88%, 06/30/2026	\$ 24,352,021	–
U.S. Treasury Notes, 2.25%, 11/15/2024	\$ 2,791,715	–

**ANMERKUNG N: Verleih von Portfeuille-Wertpapieren**

Ein Portfeuille 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 Portfeuille 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 Portfeuille möglicherweise alle aus diesen Wertpapieren generierten Erträge. Das Portfeuille 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 Portfeuille 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 Portfeuille kann angemessene Konsortialführer-, Verwaltungs- und sonstige Gebühren im Zusammenhang mit einer Ausleihung zahlen.

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

Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2022 erwirtschafteten die Portfeuillees Nettogebühreneinnahmen, die in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erträge aus der Wertpapierleihe, netto“ ausgewiesen sind.

Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2022 verdiente Brown Brothers Harriman & Co. (in seiner Funktion als Wertpapierleihstelle) ein Honorar von \$17,313 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 28. Februar 2022 verliehenen Wertpapiere und die entsprechenden ausstehenden Sicherheiten haben folgenden Wert. Die Sicherheiten beziehen sich auf die in den Portfeuilleen gehaltenen Wertpapiere.

AB FCPI –	Wert	Marktwert der Sicherheiten
Global Equity Blend		
Portfolio . . . . .		
UBS AG	\$ 188,321	205,654
Citigroup Global Markets Limited	\$ 118,113	124,885
JPMorgan Chase	\$ 67,515	70,918
Emerging Markets Growth		
Portfolio . . . . .		
Merrill Lynch	\$ 2,878,026	3,400,081
JPMorgan Chase	\$ 1,628,619	1,710,726
Morgan Stanley	\$ 907,444	953,003
UBS AG	\$ 314,129	343,041
Asia Ex-Japan Equity		
Portfolio . . . . .		
Morgan Stanley	\$ 1,575,672	1,654,778
UBS AG	\$ 1,056,973	1,154,255
JPMorgan Chase	\$ 311,254	326,947
Japan Strategic Value		
Portfolio . . . . .		
JPMorgan Chase	¥ 161,244,737	169,373,899
China Low Volatility Equity		
Portfolio . . . . .		
UBS AG	\$ 4,699,699	5,132,246

AB FCPI –	Wert	Marktwert der Sicherheiten
Citigroup Global Markets Limited	\$ 577,203	610,300
JPMorgan Chase	\$ 324,303	340,652

**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.

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

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

Wenn die Vermögenswerte verschiedener Portefeuilles zum Zwecke der gemeinsamen Verwaltung zu Pools zusammenge-

Zum 28. Februar 2022 verwaltet der Fonds die Vermögenswerte bestimmter Portefeuilles innerhalb des Fonds unter Verwendung der folgenden Pools gemeinsam:

**Pool an Vermögenswerten**

**Beteiligte Portefeuilles**

ACM Global Investments-Global Bond Pool . . . . .	Short Duration Bond Portfolio
ACM Bernstein-Global Growth Pool . . . . .	Global Equity Blend Portfolio
ACM Global Investments-Global Value Pool . . . . .	Global Equity Blend Portfolio
	Global Value Portfolio

**TABELLE 1**  
**GEBÜHRENSTRUKTUR**

**AB FCPI**

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b><u>Dynamic Diversified Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
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%
BX SGD .....	1.40%	0.10%	1.00%	2.90%
C .....	1.90%	0.10%	N/A	2.25%
C EUR .....	1.90%	0.10%	N/A	2.25%
C EUR H .....	1.90%	0.10%	N/A	2.25%
CX .....	1.70%	0.10%	N/A	2.20%
I .....	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
I EUR .....	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
I EUR H .....	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
IX .....	0.70%	0.10%	N/A	1.20%
S1 EUR H .....	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
<b><u>Global Equity Blend Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.60%	0.10%	N/A	2.01%
A EUR .....	1.60%	0.10%	N/A	2.02%
A EUR H .....	1.60%	0.10%	N/A	2.01%
A SGD .....	1.60%	0.10%	N/A	2.01%
B .....	1.60%	0.10%	1.00%	3.01%
B SGD .....	1.60%	0.10%	1.00%	3.01%
C .....	2.05%	0.10%	N/A	2.46%
C EUR .....	2.05%	0.10%	N/A	2.52%
I .....	0.80%	0.10%	N/A	1.21%
I EUR .....	0.80%	0.10%	N/A	1.23%
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%
<b><u>Global Value Portfolio</u></b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.50%	0.10%	N/A	1.71%
A EUR .....	1.50%	0.10%	N/A	1.75%
A SGD .....	1.50%	0.10%	N/A	1.71%
A SGD H .....	1.50%	0.10%	N/A	1.75%
AD .....	1.50%	0.10%	N/A	1.74%
AD AUD H .....	1.50%	0.10%	N/A	1.74%
AD CAD H .....	1.50%	0.10%	N/A	1.74%
AD EUR H .....	1.50%	0.10%	N/A	1.75%
AD GBP H .....	1.50%	0.10%	N/A	1.74%
AD HKD .....	1.50%	0.10%	N/A	1.74%
AD SGD H .....	1.50%	0.10%	N/A	1.74%
AD ZAR H .....	1.50%	0.10%	N/A	1.74%
B .....	1.50%	0.10%	1.00%	2.75%
BD(a) .....	1.50%	0.10%	1.00%	2.77%

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>Global Value Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
C .....	1.95%	0.10%	N/A	2.20%
C EUR .....	1.95%	0.10%	N/A	2.19%
I .....	0.70%	0.10%	N/A	0.92%
I EUR .....	0.70%	0.10%	N/A	0.93%
I GBP .....	0.70%	0.10%	N/A	1.12%
I SGD .....	0.70%	0.10%	N/A	0.95%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.07%
S GBP .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.07%
S GBP H .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.07%
S1 .....	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.76%
S1 EUR .....	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.75%
S1 GBP .....	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.77%
SD .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.07%

**Emerging Markets Growth Portfolio**

<b>Klasse</b>				
A .....	1.70%	0.10%	N/A	2.00%
A AUD H .....	1.70%	0.10%	N/A	2.00%
A EUR .....	1.70%	0.10%	N/A	2.00%
A HKD .....	1.70%	0.10%	N/A	2.00%
A PLN H .....	1.70%	0.10%	N/A	1.99%
A SGD .....	1.70%	0.10%	N/A	2.00%
A SGD H .....	1.70%	0.10%	N/A	2.00%
AD .....	1.70%	0.10%	N/A	2.01%
B .....	1.70%	0.10%	1.00%	3.00%
C .....	2.15%	0.10%	N/A	2.45%
C AUD H .....	2.15%	0.10%	N/A	2.44%
C EUR .....	2.15%	0.10%	N/A	2.45%
ED .....	1.70%	0.10%	1.00%	2.99%
I .....	0.90%	0.10%	N/A	1.20%
I AUD H .....	0.90%	0.10%	N/A	1.20%
I EUR .....	0.90%	0.10%	N/A	1.21%
N .....	2.15%	0.10%	N/A	2.45%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.13%
S1 .....	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.03%
S1 EUR .....	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.97%
S1 GBP .....	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.97%

**Sustainable US Thematic Portfolio\*\***

<b>Klasse</b>				
A .....	1.50%	0.05%	N/A	1.67%
A AUD H .....	1.50%	0.05%	N/A	1.67%
A CAD H .....	1.50%	0.05%	N/A	1.67%
A EUR .....	1.50%	0.05%	N/A	1.66%
A EUR H .....	1.50%	0.05%	N/A	1.67%
A GBPH .....	1.50%	0.05%	N/A	1.65%
A HKD .....	1.50%	0.05%	N/A	1.67%
A SGD H .....	1.50%	0.05%	N/A	1.68%
AN .....	1.50%	0.05%	N/A	1.67%
B .....	1.50%	0.05%	1.00%	2.67%
C .....	1.95%	0.05%	N/A	2.12%
C EUR .....	1.95%	0.05%	N/A	2.12%
C EUR H .....	1.95%	0.05%	N/A	2.12%
C SGD .....	1.95%	0.05%	N/A	2.12%
E .....	1.50%	0.05%	1.00%	2.73%

**TABELLE 1**  
**GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)**

**AB FCPI**

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>Sustainable US Thematic Portfolio** (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
I .....	0.70%	0.05%	N/A	0.87%
I EUR .....	0.70%	0.05%	N/A	0.87%
I EUR H .....	0.70%	0.05%	N/A	0.88%
I GBP .....	0.70%	0.05%	N/A	0.89%
IN .....	0.70%	0.05%	N/A	0.86%
IN EUR .....	0.70%	0.05%	N/A	0.84%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
S1 .....	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.70%
S1 EUR .....	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.71%
S1 JPY H .....	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.70%
<b>Asia Ex-Japan Equity Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.70%	0.05%	N/A	2.01%
A AUD H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.01%
A EUR .....	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
A HKD .....	1.70%	0.05%	N/A	2.01%
A SGD H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.01%
AD .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD AUD H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.01%
AD CAD H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.01%
AD EUR .....	1.70%	0.05%	N/A	2.01%
AD EUR H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.01%
AD GBP H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
AD HKD .....	1.70%	0.05%	N/A	2.01%
AD NZD H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
AD RMB H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.97%
AD SGD H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.98%
AD ZAR H .....	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
AY JPY .....	1.70%	0.05%	N/A	2.01%
BD .....	1.70%	0.05%	1.00%	3.01%
BD AUD H .....	1.70%	0.05%	1.00%	3.01%
BD CAD H .....	1.70%	0.05%	1.00%	3.00%
BD HKD .....	1.70%	0.05%	1.00%	3.00%
BD NZD H .....	1.70%	0.05%	1.00%	3.00%
BD ZAR H(b) .....	1.70%	0.05%	1.00%	2.98%
BY JPY .....	1.45%	0.05%	0.72%	2.48%
C .....	2.15%	0.05%	N/A	2.46%
C AUD H .....	2.15%	0.05%	N/A	2.43%
C EUR .....	2.15%	0.05%	N/A	2.49%
ED .....	1.70%	0.05%	1.00%	3.00%
I .....	0.90%	0.05%	N/A	1.20%
I AUD H .....	0.90%	0.05%	N/A	1.18%
I EUR .....	0.90%	0.05%	N/A	1.21%
I GBP .....	0.90%	0.05%	N/A	1.20%
ID .....	0.90%	0.05%	N/A	1.20%
ID AUD H .....	0.90%	0.05%	N/A	1.18%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.14%
S HKD .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.14%
S1 .....	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.04%
S1 EUR .....	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.01%
SD .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.14%



	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>Japan Strategic Value Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A AUD H .....	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 NZD H .....	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A PLN .....	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%
BD AUD H(b) .....	1.50%	0.05%	1.00%	3.15%
C .....	1.95%	0.05%	N/A	2.60%
C EUR .....	1.95%	0.05%	N/A	2.60%
C EUR H .....	1.95%	0.05%	N/A	2.60%
C USD .....	1.95%	0.05%	N/A	2.60%
I .....	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I EUR .....	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I EUR H .....	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I SGD .....	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 .....	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%
S1 USD H .....	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.80%
SD .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.15%
<b>China Low Volatility Equity Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A EUR .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A HKD .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A PLN H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD AUD H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD CAD H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD EUR H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD GBP H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD HKD .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD NZD H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD RMB H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD SGD H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD ZAR H .....	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
B .....	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
B EUR .....	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
BD NZD H .....	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
BD ZAR H(a) .....	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
C .....	2.15%	0.05%	N/A	2.44%

**TABELLE 1**  
**GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)**

**AB FCPI**

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>China Low Volatility Equity Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
C EUR .....	2.15%	0.05%	N/A	2.44%
I .....	0.90%	0.05%	N/A	1.19%
I EUR .....	0.90%	0.05%	N/A	1.19%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.16%
S1 .....	0.75%	0.01%(8)	N/A	0.91%
S1 EUR .....	0.75%	0.01%(8)	N/A	0.91%
<b>Short Duration Bond Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
A EUR .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
A2 .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
A2 EUR .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
A2 EUR H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
A2 HKD .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
A2 SGD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AA .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AA AUD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AA CAD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AA GBP H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AA HKD .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AA NZD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AA SGD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AJ .....	0.65%	0.10%	N/A	0.97%
AR EUR H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AT AUD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT CAD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AT EUR .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AT EUR H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AT GBP H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AT HKD .....	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT NZD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AT SGD H .....	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AX .....	0.65%	0.10%	N/A	0.97%
B .....	0.85%	0.10%	1.00%	2.17%
B2 EUR(c) .....	0.85%	0.10%	1.00%	2.13%
BT(d) .....	0.85%	0.10%	1.00%	2.14%
C .....	1.25%	0.10%	N/A	1.57%
C2 .....	1.25%	0.10%	N/A	1.57%
C2 EUR H .....	1.25%	0.10%	N/A	1.52%
I .....	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I EUR .....	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I2 .....	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I2 AUD H .....	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I2 EUR .....	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I2 EUR H .....	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
IT .....	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
IT AUD H .....	0.325%	0.10%	N/A	0.57%
N2 .....	1.35%	0.10%	N/A	1.67%
NT .....	1.35%	0.10%	N/A	1.67%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S EUR H .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S SGD H .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%
S1 2 .....	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%

**Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)**

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
S1 2 EUR .....	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
S1 EUR H .....	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
SA .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%

**Global High Yield Portfolio\*\*\***

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
A .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
A EUR .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
A2 .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
A2 CHF H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.62%
A2 EUR .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
A2 EUR H .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
A2 HKD .....	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.60%
A2 PLN H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.62%
A2 SGD .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
A2 SGD H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AA .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AA AUD H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AA CAD H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AA EUR H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AA GBP H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AA HKD .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AA NZD H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AA RMB H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AA SGD H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AA ZAR H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AK .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AK EUR .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AK EUR H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.60%
AR EUR H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AT .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AT AUD H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AT CAD H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AT EUR .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AT EUR H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AT GBP H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AT HKD .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AT NZD H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AT RMB H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AT SGD .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AT SGD H .....	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.61%
B .....	1.38%(1)	0.10%	1.00%	2.61%
B2 .....	1.38%(1)	0.10%	1.00%	2.61%
BA .....	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.58%
BA AUD H .....	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.58%
BA ZAR H(b) .....	1.36%(1)	0.10%	1.00%	2.59%
BT .....	1.38%(1)	0.10%	1.00%	2.61%
BT AUD H .....	1.38%(1)	0.10%	1.00%	2.61%
BT CAD H .....	1.38%(1)	0.10%	1.00%	2.61%
BT EUR H(e) .....	1.36%(1)	0.10%	1.00%	2.55%
BT GBP H .....	1.38%(1)	0.10%	1.00%	2.61%
BT HKD .....	1.38%(1)	0.10%	1.00%	2.61%
BT NZD H .....	1.35%(1)	0.10%	1.00%	2.46%
C .....	1.88%(2)	0.10%	N/A	2.11%
C EUR .....	1.88%(2)	0.10%	N/A	2.11%

**TABELLE 1**  
**GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)**

**AB FCPI**

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>Global High Yield Portfolio*** (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
C2 .....	1.87%(2)	0.10%	N/A	2.10%
C2 EUR .....	1.88%(2)	0.10%	N/A	2.11%
C2 EUR H .....	1.88%(2)	0.10%	N/A	2.11%
CK .....	1.88%(2)	0.10%	N/A	2.11%
CK EUR H .....	1.88%(2)	0.10%	N/A	2.10%
CT .....	1.88%(2)	0.10%	N/A	2.11%
EA .....	1.38%(1)	0.10%	0.50%	2.11%
EA AUD H .....	1.38%(1)	0.10%	0.50%	2.11%
EA ZAR H .....	1.38%(1)	0.10%	0.50%	2.11%
I .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.11%
I EUR .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.11%
I2 .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.11%
I2 AUD H .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.11%
I2 CHF H .....	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.10%
I2 EUR .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.11%
I2 EUR H .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.11%
I2 SGD .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.11%
I2 SGD H .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.11%
IA AUD H .....	0.86%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IQD .....	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.10%
IQD EUR .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.11%
IT .....	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.11%
IT AUD H .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.11%
IT CAD H .....	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.11%
IT EUR H .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.11%
IT GBP H .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.11%
IT HKD .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.12%
IT NZD H .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.10%
IT RMB H .....	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.11%
J .....	1.38%(1)	0.10%	1.00%	2.61%
N2 .....	1.93%(4)	0.10%	N/A	2.16%
NT .....	1.93%(4)	0.10%	N/A	2.17%
S1 .....	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.95%
S1 EUR .....	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.94%
S1D .....	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.95%
SA .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.05%
SHK .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.05%
SK .....	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.70%
W .....	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
W EUR .....	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
W2 .....	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
W2 CHF H .....	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
W2 EUR H .....	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT .....	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
WT AUD H .....	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT CAD H .....	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT EUR H .....	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT GBP H .....	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT RMB H .....	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%

**American Income Portfolio**

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
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	1.32%
A2 DUR PH	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
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	1.33%
A2 PLN H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 SGD	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
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	1.33%
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	1.32%
AR EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
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%
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%
B2 HKD	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
BA	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
BA AUD H	1.10%	0.10%	0.70%	2.01%
BA ZAR H(b)	1.10%	0.10%	0.70%	1.99%
BT	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
BT AUD H	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
BT CAD H	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
BT EUR(a)	1.10%	0.10%	0.70%	2.05%
BT EUR H	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
BT GBP H	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
BT HKD	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
BT NZD H	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
C	1.55%	0.10%	N/A	1.77%

**TABELLE 1**  
**GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)**

**AB FCPI**

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>American Income Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
C EUR .....	1.55%	0.10%	N/A	1.78%
C2 .....	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C2 DUR PH .....	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	1.77%
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	0.78%
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	0.77%
I2 DUR PH .....	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	0.78%
I2 SGD .....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
I2 SGD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
IA .....	0.55%	0.10%	N/A	0.78%
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	0.78%
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	0.78%
IT HKD .....	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
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	0.77%
IT SGD .....	0.55%	0.10%	N/A	0.78%
IT SGD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
J .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
L2 .....	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
L2 AUD H .....	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
L2 SGD H .....	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
LT .....	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
LT AUD H .....	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
LT SGD H .....	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
N2 .....	1.65%	0.10%	N/A	1.87%
NT .....	1.65%	0.10%	N/A	1.87%
S .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.05%
S1 .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.55%
S1 EUR .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.55%
S1D .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.55%
S1D2 .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.55%
SA .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.05%
SHK .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.05%
W .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.61%
W2 .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.61%
W2 CHF H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.61%
W2 EUR H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.61%

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>American Income Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
WT .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WT AUD H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.61%
WT EUR H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.61%
WT GBP H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.61%
WT HKD .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.61%
WT SGD H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.61%
<b>European Income Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
A USD .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
A2 .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
A2 CHF H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
A2 PLN H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
A2 SGD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.28%
A2 USD .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
A2 USD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
AA .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
AA AUD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
AA HKD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
AA RMB H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA SGD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
AA USD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
AK .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
AR .....	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AT .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
AT AUD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
AT SGD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
AT USD .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
AT USD H .....	1.10%	0.10%	N/A	1.29%
B USD .....	1.10%	0.10%	0.70%	1.99%
B2 .....	1.10%	0.10%	0.70%	1.97%
B2 USD .....	1.10%	0.10%	0.70%	1.99%
BA(f) .....	1.10%	0.10%	0.70%	1.96%
BA AUD H .....	1.10%	0.10%	0.70%	1.99%
BA USD H .....	1.10%	0.10%	0.70%	1.99%
BT .....	1.10%	0.10%	0.70%	1.99%
BT AUD H .....	1.10%	0.10%	0.70%	1.97%
BT USD(g) .....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BT USD H .....	1.10%	0.10%	0.70%	1.99%
C .....	1.55%	0.10%	N/A	1.74%
C USD .....	1.55%	0.10%	N/A	1.74%
C2 .....	1.55%	0.10%	N/A	1.74%
C2 USD .....	1.55%	0.10%	N/A	1.74%
C2 USD H .....	1.55%	0.10%	N/A	1.75%
CK .....	1.55%	0.10%	N/A	1.74%
CT USD H .....	1.55%	0.10%	N/A	1.75%
I .....	0.55%	0.10%	N/A	0.73%
I USD .....	0.55%	0.10%	N/A	0.74%
I2 .....	0.55%	0.10%	N/A	0.74%
I2 AUD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.74%
I2 CHF H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.73%
I2 USD .....	0.55%	0.10%	N/A	0.74%
I2 USD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.74%

**TABELLE 1**  
**GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)**

**AB FCPI**

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>European Income Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
IA .....	0.55%	0.10%	N/A	0.74%
IA HKD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.74%
IA SGD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.72%
IA USD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.79%
IT .....	0.55%	0.10%	N/A	0.74%
IT SGD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.72%
IT USD H .....	0.55%	0.10%	N/A	0.72%
NT USD H .....	1.65%	0.10%	N/A	1.84%
S1 .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.53%
S1 USD .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.52%
S1 USD H .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.53%
S1D .....	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.53%
SA USD H .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
SHK .....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
W2 .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.58%
W2 CHF H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.58%
W2 USD H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.58%
WA .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.58%
WA HKD H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.55%
WA USD H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.57%
WT .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.57%
WT SGD H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.54%
WT USD H .....	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.56%
<b>Emerging Markets Debt Portfolio</b>				
<b>Klasse</b>				
A .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A EUR .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2 .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2 CHF H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.30%
A2 EUR .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2 EUR H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2 HKD .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2 PLN .....	1.10%	0.05%	N/A	1.44%
A2 PLN H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2 SGD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA AUD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA CAD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA EUR H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AA GBP H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.30%
AA HKD .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA NZD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA RMB H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AA SGD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AA ZAR H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AI .....	1.10%	0.05%	N/A	1.26%
AI AUD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AR EUR .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT .....	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AT AUD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT CAD H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT EUR .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT EUR H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT GBP H .....	1.10%	0.05%	N/A	1.33%



**Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)**

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
AT HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT NZD H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT RMB H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
B2 EUR(b)	1.10%	0.05%	1.00%	2.31%
B2 HKD	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BA(a)	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BA AUD H(a)	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BA ZAR H(b)	1.10%	0.05%	1.00%	2.25%
BT	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BT AUD H(h)	1.10%	0.05%	1.00%	2.30%
BT EUR H	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BT HKD	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
C	1.55%	0.05%	N/A	1.79%
C EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.79%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.79%
C2 EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.79%
C2 EUR H	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
CT	1.55%	0.05%	N/A	1.79%
EA	1.10%	0.05%	0.50%	1.84%
EA AUD H	1.10%	0.05%	0.50%	1.83%
EA ZAR H	1.10%	0.05%	0.50%	1.84%
EI	1.10%	0.05%	0.50%	1.85%
EI AUD H	1.10%	0.05%	0.50%	1.84%
I	0.55%	0.05%	N/A	0.79%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.79%
I2 CHF H	0.55%	0.05%	N/A	0.75%
I2 EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.79%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
IT AUD H	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
IT EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.79%
IT SGD H	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
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	0.11%
S EUR H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.08%
S GBP H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.08%
S1 2	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.66%
S1 2 EUR	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.61%
S1 EUR H	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.63%
S1 GBP H	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.63%
S1QD EUR H(i)	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.66%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.11%

**Mortgage Income Portfolio**

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
A	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.29%
A2 EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.29%
A2 HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2 SGD	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
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	1.31%
AA AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.31%

**TABELLE 1**  
**GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)**

**AB FCPI**

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<b>Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse</b>				
AA HKD . . . . .	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AA RMB H . . . . .	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA SGD H . . . . .	1.10%	0.05%	N/A	1.30%
AA ZAR H . . . . .	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AR EUR H . . . . .	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AT . . . . .	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AT AUD H . . . . .	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AT EUR . . . . .	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AT GBP H . . . . .	1.10%	0.05%	N/A	1.30%
AT HKD . . . . .	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AT SGD . . . . .	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AT SGD H . . . . .	1.10%	0.05%	N/A	1.30%
AX . . . . .	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
AX EUR . . . . .	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
B2X(c) . . . . .	1.05%(5)	0.05%	0.45%	1.70%
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	1.76%
C2 . . . . .	1.55%	0.05%	N/A	1.76%
C2 EUR . . . . .	1.55%	0.05%	N/A	1.76%
C2X(j) . . . . .	1.50%(6)	0.05%	N/A	1.70%
CX . . . . .	1.50%(6)	0.05%	N/A	1.76%
I . . . . .	0.55%	0.05%	N/A	0.76%
I EUR . . . . .	0.55%	0.05%	N/A	0.75%
I2 . . . . .	0.55%	0.05%	N/A	0.75%
I2 EUR . . . . .	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
I2 EUR H . . . . .	0.55%	0.05%	N/A	0.76%
I2X . . . . .	0.50%(7)	0.05%	N/A	0.70%
IT EUR H . . . . .	0.55%	0.05%	N/A	0.76%
IX . . . . .	0.50%(7)	0.05%	N/A	0.70%
N2 . . . . .	1.65%	0.05%	N/A	1.86%
NT . . . . .	1.65%	0.05%	N/A	1.86%
S . . . . .	N/A	0.01%(8)	N/A	0.07%
S1 . . . . .	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.57%
S1 EUR . . . . .	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.56%
S1 EUR H . . . . .	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.57%
S1 JPY . . . . .	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.57%
S1X . . . . .	0.40%	0.01%(8)	N/A	0.44%
SA . . . . .	N/A	0.01%(8)	N/A	0.07%

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

\*\* Der letzte NAV wurde am 28. Januar 2022 berechnet. Siehe Anmerkung A.

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

- (a) Die Anteilklasse wurde am 20. September 2021 aufgelöst.
- (b) Die Anteilklasse wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.
- (c) Die Anteilklasse wurde am 24. Januar 2022 aufgelöst.
- (d) Die Anteilklasse wurde am 21. Januar 2022 aufgelöst.
- (e) Die Anteilklasse wurde am 30. November 2021 aufgelöst.
- (f) Die Anteilklasse wurde am 31. Januar 2022 aufgelöst.
- (g) Die Anteilklasse wurde am 22. November 2021 aufgelöst.

- (h) Die Anteilklasse wurde am 31. Dezember 2021 aufgelöst.
- (i) Die Anteilklasse wurde am 11. Oktober 2021 aufgelöst.
- (j) Die Anteilklasse wurde am 20. Oktober 2021 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.

Gebühr der Verwaltungsgesellschaft

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

Maximale Verwaltungsgebühr gemäß den Angaben im Prospekt des Fonds

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

**TABELLE 2**  
**PORTEFEUILLEUMSATZ**

**AB FCPI**

<b>AB FCPI-</b>	<b>Umsatz*</b>
Dynamic Diversified Portfolio . . . . .	145.87%
Global Equity Blend Portfolio . . . . .	-8.40%
Global Value Portfolio . . . . .	26.82%
Emerging Markets Growth Portfolio . . . . .	73.73%
Asia Ex-Japan Equity Portfolio . . . . .	11.00%
Japan Strategic Value Portfolio . . . . .	-95.44%
China Low Volatility Equity Portfolio . . . . .	0.26%
Short Duration Bond Portfolio . . . . .	99.03%
Global High Yield Portfolio . . . . .	-31.58%
American Income Portfolio . . . . .	-49.98%
European Income Portfolio . . . . .	-9.11%
Emerging Markets Debt Portfolio . . . . .	71.90%
Mortgage Income Portfolio . . . . .	-12.57%

\* Ungeprüft.

Wie im Prospekt dargelegt, kann der Anlageverwalter bei der Umsetzung der jeweiligen Anlagestrategie der Portfeuille 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 28. Februar 2022 hat der Anlageverwalter die Anlageverwaltungsdienstleistungen für die nachstehend aufgeführten Portfeuille an die folgenden verbundenen Unteranlageverwalter übertragen:

**Alliance Bernstein Australia Limited:**

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

**AllianceBernstein Limited:**

- Emerging Markets Debt Portfolio
- Global Equity Blend Portfolio
- Global Value 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

**AllianceBernstein (Japan) Ltd.:**

- Japan Strategic Value Portfolio

**Finanzinformationen zum Fonds**

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

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

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

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

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

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

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

UniCredit Bank Austria AG  
Rothschildplatz 1  
1020 Wien  
Österreich

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

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

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

ODDO BHF Aktiengesellschaft  
Bockenheimer Landstraße 10  
60323 Frankfurt am Main  
Deutschland

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

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

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

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

BANCA SELLA HOLDING S.p.A.  
Piazza Gaudenzio Sella 1  
I-13900 Biella  
Italien

CACEIS Bank Luxembourg Zweigniederlassung Amsterdam  
De Ruyterkade 6  
1013 AA Amsterdam  
P.O. Box 192  
1000 AD Amsterdam  
Niederlande

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

Allfunds Bank, S.A.U.  
Calle Estafeta nº 6 (La Moraleja)  
Complejo Pza. de la Fuente- Edificio 3  
28109, Alcobendas (Madrid)  
Spanien

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

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

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

BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, wurde von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA

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

Das Dokument mit wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) des Fonds steht unter [www.alliancebernstein.com/go/kiid](http://www.alliancebernstein.com/go/kiid) zur Verfügung.

**Mitteilungen an die Anteilinhaber**

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

**Veränderungen des Wertpapierbestands**

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

**Richtlinie zu umstrittenen Waffen**

Die Verwaltungsgesellschaft sorgt dafür, dass Unternehmen weltweit auf ihre betriebliche Verwicklung in Tretminen, Streumunition und/oder Uranmunition überprüft werden. Wenn eine solche betriebliche Verwicklung bestätigt wurde, ist es die Richtlinie der Verwaltungsgesellschaft, dem Fonds die Anlage in Wertpapiere, die von solchen Unternehmen begeben werden, nicht zu gestatten.

**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 Kauf-/Rückverkaufsgeschäft oder Verkaufs-/Rückkaufgeschäft; oder
- ein Margenleihgeschäft.

Zum 28. Februar 2022 war der Fonds in Wertpapierleihgeschäften engagiert und hielt Total-Return-Swaps (TRS), die als Transaktionstyp unter die SFT-Verordnung fallen.

**Allgemeine Angaben**

Zum 28. Februar 2022 belief sich das Vermögen über alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps hinweg auf folgende Beträge:

**Global Equity Blend Portfolio**

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$373,949	0.31%	0.70%

**Emerging Markets Growth Portfolio**

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$5,728,218	0.96%	1.59%

**Asia Ex-Japan Equity Portfolio**

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$2,943,899	0.84%	1.38%

**Japan Strategic Value Portfolio**

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	¥161,244,737	2.23%	2.28%

**China Low Volatility Equity Portfolio**

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$5,601,205	4.06%	4.46%

**Dynamic Diversified Portfolio**

Art der Anlage	Betrag	% des NAV
Total-Return-Swaps	\$140,031	0.18%

**Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten**

Im Berichtszeitraum zum 28. Februar 2022 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet.

Im Berichtszeitraum zum 28. Februar 2022 wurden keine Barsicherheiten wiederangelegt.

#### Angaben zur Konzentration

Zum 28. Februar 2022 waren Folgende die zehn größten Emittenten der bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte erhaltenen Wertpapiersicherheiten:

#### Wertpapierleihe

##### Global Equity Blend Portfolio

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$ 152,183
2	US-Regierung	\$ 115,776
3	Niederländische Regierung	\$ 47,609
4	Schwedische Regierung	\$ 44,952
5	Deutsche Regierung	\$ 37,010
6	Schweizer Regierung	\$ 3,927

##### Emerging Markets Growth Portfolio

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	Deutsche Regierung	\$ 2,509,634
2	Französische Regierung	\$ 1,464,919
3	Niederländische Regierung	\$ 919,923
4	Britische Regierung	\$ 781,465
5	US-Regierung	\$ 636,172
6	Schweizer Regierung	\$ 94,738

##### Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	Britische Regierung	\$ 1,356,923
2	Französische Regierung	\$ 849,947
3	US-Regierung	\$ 644,432
4	Deutsche Regierung	\$ 207,722
5	Niederländische Regierung	\$ 58,850
6	Schweizer Regierung	\$ 18,106

##### Japan Strategic Value Portfolio

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	Französische Regierung	¥118,541,819
2	Niederländische Regierung	¥ 30,487,094
3	US-Regierung	¥ 10,965,243
4	Schweizer Regierung	¥ 9,379,743

##### China Low Volatility Equity Portfolio

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	US-Regierung	\$ 2,794,000
2	Französische Regierung	\$ 1,895,457
3	Deutsche Regierung	\$ 923,608
4	Niederländische Regierung	\$ 231,593
5	Schwedische Regierung	\$ 219,675
6	Schweizer Regierung	\$ 18,865

#### Total-Return-Swaps

Zum 28. Februar 2022 wurden keine Wertpapiersicherheiten für Total-Return-Swaps erhalten.

Zum 28. Februar 2022 waren Folgende die zehn größten Gegenparteien bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps:

##### Global Equity Blend Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	UBS AG	\$ 188,321
	2	Citigroup Global Markets Limited	\$ 118,113
	3	JPMorgan Chase	\$ 67,515

##### Emerging Markets Growth Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	\$ 2,878,026
	2	JPMorgan Chase	\$ 1,628,619
	3	Morgan Stanley	\$ 907,444
	4	UBS AG	\$ 314,129

##### Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Morgan Stanley	\$ 1,575,672
	2	UBS AG	\$ 1,056,973
	3	JPMorgan Chase	\$ 311,254

##### Japan Strategic Value Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	JPMorgan Chase	¥ 161,244,737

##### China Low Volatility Equity Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	UBS AG	\$ 4,699,699
	2	Citigroup Global Markets Limited	\$ 577,203
	3	JPMorgan Chase	\$ 324,303

##### Dynamic Diversified Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	Morgan Stanley	\$ 209,571
	2	UBS AG	\$ (54,913)
	3	JPMorgan Chase	\$ (14,627)

#### Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

##### Wertpapierleihe

Zum 28. Februar 2022 wurden die erhaltenen Sicherheiten bei drei Depotbanken gehalten:

##### Global Equity Blend Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 191,074
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$ 115,777
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$ 94,606

##### Emerging Markets Growth Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 5,612,872
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$ 636,171
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$ 157,808

##### Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 1,960,559
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$ 644,432
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$ 530,989

##### Japan Strategic Value Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	¥158,408,656
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	¥ 10,965,243

##### China Low Volatility Equity Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$ 2,794,000
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$ 2,360,974
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 928,224

**Total-Return-Swaps**

Zum 28. Februar 2022 wurden keine Wertpapier- und Barsicherheiten für Total-Return-Swaps erhalten.

**Verwahrung der gewährten Sicherheiten**

**Total-Return-Swaps**

Zum 28. Februar 2022 wurden keine Wertpapier- und Barsicherheiten für Total-Return-Swaps gewährt.

**Erträge/Kosten**

Zum 28. Februar 2022 belaufen sich die Erträge und Kosten für alle Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total-Return-Swaps auf Folgendes:

**Wertpapierleihe**

**Global Equity Blend Portfolio**

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 3,997	80%
Für dritte Partei	\$ 999	20%

**Global Value Portfolio**

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 1,731	80%
Für dritte Partei	\$ 433	20%

**Emerging Markets Growth Portfolio**

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 28,924	80%
Für dritte Partei	\$ 7,231	20%

**Sustainable US Thematic Portfolio**

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 23,479	80%
Für dritte Partei	\$ 5,870	20%

**Asia Ex-Japan Equity Portfolio**

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 3,461	80%
Für dritte Partei	\$ 865	20%

**Japan Strategic Value Portfolio**

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	¥ 341,176	80%
Für dritte Partei	¥ 85,294	20%

**China Low Volatility Equity Portfolio**

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 4,691	80%
Für dritte Partei	\$ 1,173	20%

**Total-Return-Swaps**

**Dynamic Diversified Portfolio**

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$ 280,007	100%
Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$ 61,431	100%

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

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

**Zusammenfassende Transaktionsangaben**

Zum 28. Februar 2022 besitzen die verschiedenen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Returns-Swaps folgende Fälligkeiten:

**Wertpapierleihe**

**Global Equity Blend Portfolio**

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$373,949

**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	\$5,728,218

**Asia Ex-Japan Equity Portfolio**

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$2,943,899

**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	¥161,244,737

**China Low Volatility Equity Portfolio**

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$5,601,205

**Total-Return-Swaps**

**Dynamic Diversified Portfolio**

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$209,571
Ein bis drei Monate	\$(14,627)
Drei Monate bis ein Jahr	\$(54,913)
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$0



Zum 28. Februar 2022 kommen folgende Abrechnungs- und Clearing-Mechanismen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps zum Einsatz:

Wertpapierleihe

**Global Equity Blend Portfolio**

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$373,949

**Emerging Markets Growth Portfolio**

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$5,728,218

**Asia Ex-Japan Equity Portfolio**

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$2,943,899

**Japan Strategic Value Portfolio**

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	¥161,244,737

**China Low Volatility Equity Portfolio**

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$5,601,205

Total-Return-Swaps

**Dynamic Diversified Portfolio**

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	\$140,031

Die zusammenfassenden Transaktionsangaben für Sicherheitspositionen (einschließlich Barmittel), die zum 28. Februar 2022 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	Französische Staatsanleihe 1.00%, 05/25/2027	\$37,018	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 1.25%, 05/31/2028	\$37,017	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.88%, 11/15/2030	\$37,017	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.88%, 07/31/2025	\$37,013	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 1.50%, 02/15/2023	\$37,010	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 0.75%, 05/12/2028	\$22,479	AAA	>1 Jahr	SEK	USA
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 01/25/2023	\$22,477	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2026	\$22,477	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 05/25/2022	\$22,474	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 2.50%, 05/12/2025	\$22,473	AAA	>1 Jahr	SEK	USA
UBS AG	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	\$20,579	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Schweiz
JPMorgan Chase	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 03/09/2022	\$12,765	AA	Weniger als ein Monat	€	USA
JPMorgan Chase	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 01/04/2023	\$12,765	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	\$12,765	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	\$12,765	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 2.25%, 07/15/2022	\$12,367	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2023	\$5,990	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2026	\$5,350	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 2.00%, 11/15/2026	\$4,591	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	Schweizer Staatsanleihe 4.00%, 04/08/2028	\$3,927	AAA	>1 Jahr	CHF	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.88%, 10/31/2023	\$130	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 1.50%, 08/15/2026	\$5	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 11/15/2027	\$3	AA+	>1 Jahr	\$	USA

\* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

**Emerging Markets Growth Portfolio**

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 03/10/2023	\$612,004	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	\$611,994	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 11/15/2028	\$611,972	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 02/15/2031	\$611,965	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/11/2025	\$611,959	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 04/30/2024	\$340,187	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	\$307,929	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	\$307,927	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 01/04/2023	\$307,924	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 03/09/2022	\$307,923	AA	Weniger als ein Monat	€	USA
Morgan Stanley	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 03/22/2029	\$171,541	AA	>1 Jahr	£	USA
Morgan Stanley	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 03/22/2024	\$171,541	AA	>1 Jahr	£	USA
Morgan Stanley	Britische Staatsanleihe (Gilt) 4.13%, 07/22/2030	\$171,540	AA	>1 Jahr	£	USA
Morgan Stanley	Französische Staatsanleihe 0.75%, 11/25/2028	\$171,538	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2023	\$144,487	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2026	\$129,046	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 2.00%, 11/15/2026	\$110,745	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Morgan Stanley	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.25%, 11/22/2027	\$95,303	AA	>1 Jahr	£	USA
JPMorgan Chase	Schweizer Staatsanleihe 4.00%, 04/08/2028	\$94,738	AAA	>1 Jahr	CHF	USA
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 1.25%, 05/31/2028	\$61,747	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 1.00%, 05/25/2027	\$61,747	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.88%, 11/15/2030	\$61,747	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.88%, 07/31/2025	\$61,739	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 1.50%, 02/15/2023	\$61,734	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	\$34,327	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Schweiz
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 0.38%, 11/30/2025	\$7	AA+	>1 Jahr	\$	USA

\* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

**Asia Ex-Japan Equity Portfolio**

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Morgan Stanley	Britische Staatsanleihe (Gilt) 4.13%, 07/22/2030	\$297,860	AA	>1 Jahr	£	USA
Morgan Stanley	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 03/22/2029	\$297,860	AA	>1 Jahr	£	USA
Morgan Stanley	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 03/22/2024	\$297,860	AA	>1 Jahr	£	USA
Morgan Stanley	Britische Staatsanleihe (Gilt) 2.50%, 07/17/2024	\$297,860	AA	>1 Jahr	£	USA
Morgan Stanley	Französische Staatsanleihe 0.75%, 11/25/2028	\$297,855	AA	>1 Jahr	€	USA
UBS AG	Französische Staatsanleihe 1.00%, 05/25/2027	\$207,765	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.88%, 11/15/2030	\$207,764	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz

**Asia Ex-Japan Equity Portfolio (Fortsetzung)**

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 1.25%, 05/31/2028	\$207,763	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.88%, 07/31/2025	\$207,739	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 1.50%, 02/15/2023	\$207,722	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Schweiz
Morgan Stanley	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.25%, 11/22/2027	\$165,483	AA	>1 Jahr	£	USA
UBS AG	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	\$115,502	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Schweiz
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	\$58,850	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	\$58,850	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 03/09/2022	\$58,849	AA	Weniger als ein Monat	€	USA
JPMorgan Chase	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 01/04/2023	\$58,849	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2023	\$27,614	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2026	\$24,663	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 2.00%, 11/15/2026	\$21,165	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	Schweizer Staatsanleihe 4.00%, 04/08/2028	\$18,106	AAA	>1 Jahr	CHF	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 0.38%, 11/30/2025	\$1	AA+	>1 Jahr	\$	USA

\* 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
JPMorgan Chase	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	¥30,487,094	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	¥30,486,987	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 01/04/2023	¥30,486,647	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 03/09/2022	¥30,486,504	AA	Weniger als ein Monat	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2023	¥14,305,210	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2026	¥12,776,471	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 2.00%, 11/15/2026	¥10,964,552	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	Schweizer Staatsanleihe 4.00%, 04/08/2028	¥9,379,743	AAA	>1 Jahr	CHF	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 0.38%, 11/30/2025	¥691	AA+	>1 Jahr	\$	USA

\* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

**China Low Volatility Equity Portfolio**

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
UBS AG	Französische Staatsanleihe 1.00%, 05/25/2027	\$923,803	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.88%, 11/15/2030	\$923,799	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 1.25%, 05/31/2028	\$923,794	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.88%, 07/31/2025	\$923,679	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 1.50%, 02/15/2023	\$923,608	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	\$513,563	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Schweiz

**China Low Volatility Equity Portfolio (Fortsetzung)**

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 0.75%, 05/12/2028	\$109,851	AAA	>1 Jahr	SEK	USA
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 01/25/2023	\$109,844	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2026	\$109,841	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 05/25/2022	\$109,830	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 2.50%, 05/12/2025	\$109,824	AAA	>1 Jahr	SEK	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	\$61,317	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	\$61,317	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 03/09/2022	\$61,316	AA	Weniger als ein Monat	€	USA
JPMorgan Chase	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 01/04/2023	\$61,316	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 2.25%, 07/15/2022	\$60,435	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2023	\$28,771	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2026	\$25,697	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 2.00%, 11/15/2026	\$22,052	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	Schweizer Staatsanleihe 4.00%, 04/08/2028	\$18,865	AAA	>1 Jahr	CHF	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.88%, 10/31/2023	\$635	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 1.50%, 08/15/2026	\$26	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 11/15/2027	\$14	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 0.38%, 11/30/2025	\$1	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 Luxembourg  
RCS: B34405

**VERWALTUNGSRAT DER  
VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

**Silvio Cruz**  
**Yves Prussen (bis 11. Februar 2022)**  
**Bertrand Reimmel**  
**Steven Eisenberg**  
**Mark Manley (bis 31. Dezember 2021)**  
**Eileen Koo (seit 17. Februar 2022)**  
**John Schiavetta (seit 17. Februar 2022)**

**ANLAGEVERWALTER\***

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

**VERWALTUNGSSTELLE\* UND VERWAHRSTELLE**

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

**REGISTER- UND TRANSFERSTELLE**

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

**VERTRIEBSSTELLE**

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

**UNABHÄNGIGER WIRTSCHAFTSPRÜFER**

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

**RECHTSBERATER**

*In Luxemburg*

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

*In den Vereinigten Staaten*

**Dechert LLP**  
One International Place  
40<sup>th</sup> Floor  
100 Oliver Street  
Boston, MA 02110  
Vereinigte Staaten von Amerika

\* Von der Verwaltungsgesellschaft delegiert.



**ALLIANCEBERNSTEIN®**

ABI-SRS-SW-DA-0222