



ALLIANCEBERNSTEIN®

JAHRESBERICHT

AB FCP I

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

	<u>Seite</u>
Brief an die Anteilhaber	1
Wertentwicklung der Anteile	2
Verzeichnis der Anlagewerte	13
Zusammensetzung des Fondsvermögens	142
Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens	146
Umlaufende Anteile	150
Statistische Informationen	158
Anmerkungen zum Jahresabschluss	176
Tabelle 1 – Gebührenstruktur	198
Tabelle 2 – Portefeuilleumsatz	212
Bericht des unabhängigen Wirtschaftsprüfers	213
Informationen für die Anteilhaber (ungeprüft)	215

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

20. September 2022

Sehr geehrte Anteilinhaber,

der vorliegende Bericht bietet Ihnen eine aktuelle Übersicht über AB FCP I (der „Fonds“) für den Jahresberichtszeitraum zum 31. August 2022.

In dem Zwölfmonatszeitraum zum 31. August 2022 haben US-Aktien, internationale Aktien und Schwellenmarkt-Aktien an Boden verloren. Anfangs überlagerte die positive Ertragsdynamik die Bedenken im Zusammenhang mit Coronavirus-Varianten und Unterbrechungen der Lieferkette. Die Volatilität nahm zu, da die anhaltend hohe Inflation für eine weltweite Straffung der Geldpolitik sorgte, angeführt durch die US-Notenbank (die „Fed“). Die durch Russlands Invasion in der Ukraine ausgelöste eskalierende Energiekrise in Europa und die anhaltende Schwäche Chinas trugen zur Furcht vor einem schweren, weltweiten konjunkturellen Abschwung bei.

Die Fed erhöhte die Zinssätze in diesem Zeitraum viermal, darunter waren zwei aufeinander folgende Zinsschritte in Höhe von 0.75%. Die Aktienmärkte erholten sich kurz, da einige Wirtschaftsdaten schwächer ausfielen als erwartet und auf eine etwas niedrigere Inflation in den USA hindeuteten. Dies sorgte für Zuversicht, dass die Leitzinsen ihren Höchststand auf einem niedrigeren Niveau erreichen könnten. Aktien fielen drastisch, nachdem der Vorsitzende der Fed, Jerome Powell, verlauten ließ, dass die Fed bereit wäre, eine Rezession zu riskieren, um die Inflation zu senken.

Vor dem Hintergrund steigender Zinsen gerieten Wachstumswerte im nahezu gesamten Zeitraum unter Druck. Auf den Large-Cap-Märkten gaben sowohl Wachstums- als auch

Substanzwerte in absoluten Zahlen nach, doch schnitten Substanzwerte deutlich besser ab als Wachstumsaktien. Large-Cap-Aktien schlugen Small-Cap-Aktien auf relativer Basis, gaben aber absolut gesehen nach.

Die Renditen an den Märkten für festverzinsliche Staatsanleihen stiegen rapide an, und die Anleihekurse waren in allen entwickelten Märkten rückläufig. Die meisten großen Zentralbanken begannen mit der Straffung ihrer Geldpolitik, indem sie die kurzfristigen Zinssätze erhöhten und die Anleihekäufe beendeten, um die hohe und anhaltende Inflation zu bekämpfen.

In den Kreditsektoren blieben Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating hinter Staatsanleihen zurück und lieferten in den USA gegenüber US-Staatsanleihen eine Underperformance, während sie in der Eurozone gegenüber Staatsanleihen aus der Eurozone eine Outperformance erzielten. Hochverzinsliche Unternehmensanleihen übertrafen die jeweiligen Märkte für Staatsanleihen in den USA und der Eurozone. Verbriefte Vermögenswerte entwickelten sich im Allgemeinen besser als Unternehmensanleihen. Anleihen aus Schwellenländern hinkten hinterher, da der US-Dollar gegenüber den meisten Währungen von Industrie- und Schwellenländern fiel. Die Brent-Rohölpreise legten aufgrund der erhöhten Nachfrage und der begrenzten Produktionssteigerungen der großen Ölproduzenten zu.

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>
<u>Dynamic Diversified Portfolio</u>				
Klasse				
A	-10.07%	-16.30%	18.95%	35.20%
A EUR.....	0.35%	-1.66%	20.21%	94.04%
A EUR H.....	-11.44%	-17.92%	17.57%	16.07%
AX.....	-10.08%	-16.30%	19.03%	63.00%
AX EUR.....	0.33%	-1.62%	20.22%	106.19%
AX SGD.....	-7.29%	-12.98%	17.59%	32.51%
BX.....	-10.52%	-17.08%	17.78%	36.60%
BX SGD.....	-7.69%	-13.77%	16.45%	11.68%
C.....	-10.21%	-16.56%	18.58%	31.33%
C EUR.....	0.15%	-2.00%	19.83%	88.46%
C EUR H.....	-11.75%	-18.33%	17.17%	12.60%
CX.....	-10.21%	-16.52%	18.61%	55.33%
I.....	-9.77%	-15.74%	19.78%	45.27%
I EUR.....	0.65%	-1.00%	21.00%	108.46%
I EUR H.....	-11.12%	-17.32%	18.36%	24.73%
IX.....	-9.76%	-15.69%	19.83%	83.07%
<u>Global Equity Blend Portfolio</u>				
Klasse				
A	-14.36%	-21.74%	34.67%	130.70%
A EUR.....	-4.41%	-8.05%	36.08%	170.44%
A EUR H.....	-16.07%	-23.68%	33.00%	34.73%
A SGD.....	-11.71%	-18.65%	33.08%	55.07%
B.....	-14.78%	-22.53%	33.35%	90.80%
B SGD.....	-12.15%	-19.46%	31.77%	30.77%
C.....	-14.53%	-22.09%	34.11%	78.57%
C EUR.....	-4.51%	-9.73%(1)	35.59%	-9.73%
I.....	-13.99%	-21.11%	35.78%	169.40%
I EUR.....	-4.05%	-7.33%	37.19%	215.67%
S HKD.....	-13.08%	-19.45%	37.70%	151.20%
S1.....	-13.76%	-20.73%	36.26%	159.95%
S1 EUR.....	-3.78%	-6.88%	37.70%	221.78%
S1 GBP.....	-0.43%	-6.19%	32.45%	268.41%
S1 SGD.....	-11.09%	-17.61%	34.64%	87.25%
<u>Global Value Portfolio</u>				
Klasse				
A	-13.90%	-18.42%	33.86%	80.30%
A EUR.....	-3.96%	-4.22%	35.26%	60.23%
A SGD.....	-11.30%	-15.23%	32.30%	-2.89%
A SGD H.....	-14.37%	-18.85%	33.39%	20.80%
AD.....	-13.95%	-18.48%	33.96%	24.83%
AD AUD H.....	-15.08%	-19.70%	32.30%	19.19%
AD CAD H.....	-14.46%	-19.03%	32.80%	16.35%
AD EUR H.....	-15.32%	-20.18%	32.18%	8.91%
AD GBP H.....	-14.87%	-19.40%	32.52%	12.22%
AD HKD.....	-13.54%	-17.70%	34.43%	27.08%
AD ZAR H.....	-13.03%	-15.47%	39.20%	77.24%
B.....	-14.38%	-19.26%	32.58%	45.90%
C.....	-14.12%	-18.79%	33.29%	70.27%
C EUR.....	-4.19%	-4.64%	34.63%	97.60%
I.....	-13.56%	-17.78%	34.97%	112.30%
I EUR.....	-3.52%	-3.34%	36.37%	81.22%
I GBP.....	-0.14%	-2.47%(2)	-	-2.47%
I SGD.....	-10.89%	-14.54%	33.36%	10.13%
S.....	-13.17%	-17.05%	36.20%	66.29%
S GBP.....	0.28%	-1.82%	32.47%	161.70%
S GBP H.....	-14.07%	-17.95%	34.87%	29.47%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Global Value Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
S1	-13.46%	-17.64%	35.26%	80.55%
S1 EUR	-3.47%	-3.22%	36.66%	140.91%
S1 GBP	-0.10%	-2.53%	31.47%	204.75%
SD	-13.17%	-17.06%	36.22%	46.48%

Emerging Markets Growth Portfolio

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Klasse				
A	-11.91%	-23.98%	16.77%	324.60%
A AUD H	-13.14%	-25.39%	15.32%	22.07%
A EUR	-1.72%	-10.68%	17.96%	156.93%
A HKD	-11.53%	-23.28%	17.19%	27.00%
A PLN H	-11.97%	-23.96%	15.02%	-5.22%
A SGD	-9.22%	-20.98%	15.39%	39.45%
A SGD H	-12.29%	-24.38%	16.28%	-3.87%
AD	-11.90%	-23.97%	16.73%	18.40%
B	-12.35%	-24.73%	15.61%	217.20%
C	-12.11%	-24.31%	16.25%	122.46%
C EUR	-1.95%	-11.10%	17.48%	126.82%
ED	-12.34%	-24.69%	15.60%	-16.56%
I	-11.55%	-23.36%	17.71%	192.69%
I AUD H	-12.68%	-24.69%	16.26%	33.20%
I EUR	-1.33%	-9.98%	18.94%	205.97%
N	-12.12%	-24.33%	16.28%	38.73%
S1	-11.50%	-23.24%	17.92%	165.20%
S1 EUR	-1.21%	-9.75%	19.14%	241.75%
S1 GBP	2.27%	-9.08%	14.67%	322.49%

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Klasse				
A	-16.51%	-20.72%	32.23%	45.93%
A AUD H	-17.39%	-21.81%	30.35%	44.40%
A EUR	-6.89%	-6.89%	33.60%	117.92%
A HKD	-16.15%	-19.99%	32.70%	47.80%
A SGD H	-16.76%	-21.00%	31.52%	4.60%
AD	-16.54%	-20.75%	32.29%	45.97%
AD AUD H	-17.44%	-21.86%	30.38%	44.60%
AD CAD H	-16.95%	-21.36%	31.11%	3.66%
AD EUR	-6.91%	-6.86%	33.66%	118.05%
AD EUR H	-17.80%	-22.32%	30.32%	4.57%
AD GBP H	-17.26%	-21.63%	30.89%	16.48%
AD HKD	-16.15%	-19.98%	32.75%	47.89%
AD NZD H	-17.02%	-21.20%	30.89%	37.08%
AD RMB H	-16.25%	-19.38%	34.60%	44.23%
AD ZAR H	-15.54%	-18.06%	36.93%	96.73%
AY JPY	0.88%	0.12%	37.36%	119.11%
BD	-16.90%	-21.46%	30.90%	28.53%
BD AUD H	-17.87%	-22.68%	29.07%	28.64%
BD HKD	-16.55%	-20.75%	31.40%	30.20%
BY JPY	0.64%	-0.35%	36.73%	108.28%
C	-16.72%	-21.08%	31.61%	37.80%
C EUR	-7.09%	-7.22%	32.91%	105.91%
ED	-16.97%	-21.50%	30.91%	-12.99%
ED AUD H	-6.36%(3)	-	-	-6.36%
I	-16.18%	-20.07%	33.30%	61.67%
I AUD H	-17.07%	-21.18%	31.40%	62.27%
I EUR	-6.47%	-6.11%	34.70%	141.54%
I GBP	-3.18%	-5.41%	29.65%	56.33%
S	-15.73%	-19.23%	34.74%	85.67%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Asia Ex-Japan Equity Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
S HKD	-15.37%	-18.49%	35.24%	63.51%
S1	-16.11%	-19.96%	33.56%	65.20%
S1 EUR.....	-6.41%	-5.95%	34.95%	146.85%
SD	-15.74%	-19.23%	34.75%	50.78%

Japan Strategic Value Portfolio

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Klasse				
A	3.98%	3.04%	22.36%	20.31%
A CZK H.....	5.93%	6.03%	21.36%	0.98%
A EUR.....	-3.99%	-4.17%	19.12%	19.98%
A EUR H.....	3.40%	1.92%	21.13%	84.27%
A PLN.....	-3.66%	0.12%	-	-1.22%
A SGD.....	-11.30%	-15.19%	16.31%	-12.07%
A SGD H.....	4.41%	3.41%	22.31%	15.27%
A USD.....	-13.95%	-18.40%	17.90%	0.85%
A USD H.....	4.57%	3.63%	22.52%	128.53%
AD.....	3.99%	3.04%	22.32%	49.19%
AD AUD H.....	3.87%	2.66%	21.29%	51.22%
AD NZD H.....	4.26%	3.30%	21.85%	61.03%
AD USD H.....	4.57%	3.65%	22.50%	44.49%
AD ZAR H.....	6.57%	8.05%	27.68%	129.56%
C	3.53%	2.28%	21.69%	12.04%
C EUR.....	-4.42%	-4.84%	18.52%	19.75%
C EUR H.....	2.91%	1.18%	20.61%	72.07%
C USD.....	-14.33%	-19.01%	17.29%	-5.97%
I.....	4.41%	3.89%	23.26%	37.60%
I EUR.....	-3.57%	-3.32%	20.03%	47.06%
I EUR H.....	3.82%	2.73%	22.12%	103.07%
I SGD.....	-10.94%	-14.51%	17.21%	-0.21%
I USD.....	-13.60%	-17.74%	18.80%	15.45%
I USD H.....	4.97%	4.44%	23.47%	149.07%
S EUR H.....	4.17%	3.68%	23.60%	103.07%
S1 EUR.....	-3.56%	-3.12%	20.65%	44.95%
S1 USD.....	-13.55%	-17.54%	19.41%	21.78%
SD	4.81%	4.81%	24.80%	80.75%

China Low Volatility Equity Portfolio

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Klasse				
A	-14.81%	-25.97%	-4.08%	376.80%
A EUR.....	-4.95%	-13.02%	-3.09%	188.39%
A HKD	-14.44%	-25.30%	-3.73%	20.25%
A PLN H.....	-13.61%	-24.96%	-5.05%	-19.43%
AD.....	-14.78%	-25.96%	-4.05%	25.49%
AD AUD H.....	-15.58%	-27.00%	-4.96%	17.65%
AD CAD H.....	-15.26%	-26.67%	-4.60%	14.97%
AD EUR H.....	-16.27%	-27.63%	-5.21%	6.87%
AD GBP H.....	-15.55%	-26.86%	-4.62%	12.53%
AD HKD.....	-14.43%	-25.30%	-3.71%	28.15%
AD NZD H.....	-15.06%	-26.34%	-4.83%	23.77%
AD SGD H.....	-15.05%	-26.26%	-4.32%	17.60%
AD ZAR H.....	-14.07%	-24.07%	-0.41%	72.32%
B	-15.23%	-26.71%	-5.01%	271.90%
B EUR.....	-5.42%	-13.89%	-4.02%	140.57%
BD NZD H.....	-15.48%	-27.11%	-5.71%	14.09%
C	-15.01%	-26.32%	-4.51%	8.78%
C EUR.....	-5.17%	-13.43%	-3.51%	40.85%
I.....	-14.45%	-25.38%	-3.31%	479.60%
I EUR.....	-4.55%	-12.33%	-2.30%	233.16%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
China Low Volatility Equity Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
S	-14.02%	-24.61%	-2.31%	151.77%
S1	-14.34%	-25.17%	-3.05%	113.07%
S1 EUR	-4.41%	-12.08%	-2.02%	194.81%

Short Duration Bond Portfolio

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Klasse				
A	-2.16%	-3.93%	0.11%	110.97%
A EUR	9.13%	12.85%	1.24%	32.43%
A2	-2.10%	-3.85%	0.05%	70.09%
A2 EUR	9.28%	12.99%	1.10%	32.19%
A2 EUR H	-3.10%	-5.18%	-0.82%	-8.47%
A2 HKD	-1.67%	-2.98%	0.45%	29.95%
AA	-2.08%	-3.84%	0.05%	-0.14%
AA AUD H	-2.36%	-4.18%	-0.34%	3.38%
AA CAD H	-2.15%	-3.90%	-0.10%	-2.28%
AA GBP H	-2.35%	-4.11%	-0.28%	-5.99%
AA HKD	-1.67%	-2.98%	0.47%	1.08%
AA SGD H	-2.07%	-3.84%	-0.03%	-1.58%
AJ	-2.04%	-3.72%	0.29%	88.48%
AT	-2.16%	-3.94%	-0.02%	52.88%
AT AUD H	-2.43%	-4.26%	-0.34%	19.58%
AT CAD H	-2.08%	-3.88%	-0.06%	3.60%
AT EUR	9.29%	13.03%	1.09%	73.35%
AT EUR H	-3.06%	-5.18%	-0.91%	-9.32%
AT GBP H	-2.41%	-4.18%	-0.21%	-3.09%
AT HKD	-1.67%	-2.97%	0.37%	29.86%
AT NZD H	-2.01%	-3.60%	-0.02%	9.70%
AT SGD H	-2.14%	-3.85%	0.01%	-2.49%
AX	-2.03%	-3.62%	0.13%	176.59%
B	-2.51%	-4.76%	-0.90%	62.64%
C	-2.22%	-4.20%	-0.34%	51.06%
C2	-2.28%	-4.27%	-0.33%	47.22%
C2 EUR H	-3.28%	-5.53%	-1.22%	-13.47%
I	-1.73%	-3.23%	0.55%	138.40%
I EUR	9.60%	13.69%	1.66%	49.93%
I2	-1.75%	-3.23%	0.60%	39.46%
I2 EUR	9.56%	13.64%	1.62%	77.21%
I2 EUR H	-2.71%	-4.61%	-0.19%	-2.00%
IT	-1.74%	-3.24%	0.59%	4.18%
N2	-2.36%	-4.34%	-0.41%	-6.07%
NT	-2.32%	-4.28%	-0.49%	-6.14%
S	-1.56%	-2.82%	1.08%	0.45%
S1 2	-1.68%	-3.08%	0.84%	9.07%
S1 2 EUR	9.70%	13.93%	1.85%	35.55%
SA	-1.55%	-2.81%	1.14%	11.06%

Global High Yield Portfolio

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Klasse				
A	-8.53%	-13.42%	10.64%	212.81%
A EUR	1.67%	1.71%	11.68%	180.68%
A2	-8.75%	-13.50%	10.63%	241.31%
A2 CHF H	-10.07%	-15.15%	9.19%	-5.93%
A2 EUR	1.76%	1.62%	11.78%	199.60%
A2 EUR H	-10.00%	-15.02%	9.52%	42.13%
A2 HKD	-8.37%	-12.74%	11.06%	171.80%
A2 PLN H	-7.52%	-11.86%	9.94%	-4.22%
A2 SGD	-6.00%	-10.12%	9.29%	53.19%
A2 SGD H	-9.04%	-13.76%	10.49%	30.80%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AA.....	-8.72%	-13.48%	10.53%	14.54%
AA AUD H.....	-9.62%	-14.44%	10.08%	13.25%
AA CAD H.....	-9.02%	-13.80%	10.29%	5.06%
AA EUR H.....	-9.99%	-15.03%	9.45%	-4.34%
AA GBP H.....	-9.47%	-14.32%	10.18%	1.06%
AA HKD.....	-8.37%	-12.73%	10.96%	12.34%
AA NZD H.....	-9.17%	-13.84%	10.29%	13.85%
AA RMB H.....	-8.38%	-12.04%	13.03%	29.17%
AA SGD H.....	-9.09%	-13.73%	10.45%	9.41%
AA ZAR H.....	-7.39%	-10.03%	15.46%	67.01%
AK.....	-8.77%	-13.47%	10.56%	18.61%
AK EUR.....	1.81%	1.56%	11.74%	53.56%
AK EUR H.....	-10.08%	-15.06%	9.46%	2.20%
AR EUR H.....	-10.01%	-15.05%	9.53%	-2.86%
AT.....	-8.92%	-13.61%	10.42%	280.57%
AT AUD H.....	-9.55%	-14.38%	9.97%	74.53%
AT CAD H.....	-9.02%	-13.90%	10.35%	31.19%
AT EUR.....	1.66%	1.69%	11.41%	149.97%
AT EUR H.....	-9.96%	-15.00%	9.44%	41.43%
AT GBP H.....	-9.46%	-14.29%	10.19%	32.81%
AT HKD.....	-8.37%	-12.72%	10.90%	172.21%
AT NZD H.....	-9.25%	-13.81%	10.22%	31.92%
AT RMB H.....	-8.40%	-12.06%	13.04%	63.00%
AT SGD.....	-5.91%	-10.04%	9.27%	86.19%
AT SGD H.....	-8.99%	-13.75%	10.57%	30.64%
B.....	-9.06%	-14.35%	9.56%	140.08%
B2.....	-9.24%	-14.39%	9.55%	207.32%
BA.....	-9.22%	-14.38%	9.57%	5.11%
BA AUD H.....	-10.17%	-15.38%	9.05%	3.73%
BT.....	-9.21%	-14.40%	9.56%	138.05%
BT AUD H.....	-9.98%	-15.21%	8.97%	54.48%
BT HKD.....	-8.85%	-13.61%	9.86%	138.03%
BT NZD H.....	-9.46%	-14.44%	9.20%	20.71%
C.....	-8.81%	-13.88%	10.15%	164.27%
C EUR.....	1.74%	1.22%	11.19%	148.28%
C2.....	-9.03%	-13.99%	10.07%	111.50%
C2 EUR.....	1.54%	1.11%	11.22%	171.96%
C2 EUR H.....	-10.24%	-15.45%	8.97%	11.67%
CK.....	-8.99%	-13.93%	10.08%	13.41%
CK EUR H.....	-10.18%	-15.45%	8.98%	-1.96%
CT.....	-9.03%	-13.96%	10.03%	26.21%
EA.....	-9.03%	-13.98%	10.08%	-3.19%
EA AUD H.....	-9.86%	-14.90%	9.55%	-9.37%
EA ZAR H.....	-7.65%	-10.50%	14.82%	6.81%
I.....	-8.52%	-12.93%	11.24%	261.44%
I EUR.....	1.94%	2.25%	12.28%	215.99%
I2.....	-8.57%	-13.07%	11.14%	94.98%
I2 AUD H.....	-9.32%	-13.99%	10.66%	72.60%
I2 CHF H.....	-9.90%	-14.77%	9.76%	-2.27%
I2 EUR.....	2.01%	2.11%	12.35%	164.66%
I2 EUR H.....	-9.77%	-14.62%	10.05%	51.47%
I2 SGD.....	-5.76%	-9.65%	9.79%	60.14%
I2 SGD H.....	-8.82%	-13.36%	11.06%	13.73%
IA AUD H.....	-9.42%	-14.03%	10.59%	18.53%
IQD.....	-8.59%	-13.15%	11.21%	43.42%
IQD EUR.....	2.11%	2.25%	12.35%	100.42%
IT.....	-8.49%	-13.09%	11.22%	22.61%
IT AUD H.....	-9.34%	-14.03%	10.62%	23.79%
IT CAD H.....	-8.84%	-13.39%	10.85%	18.02%
IT EUR H.....	-9.80%	-14.62%	10.03%	-9.80%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
IT GBP H	-9.21%	-13.77%	10.70%	14.14%
IT HKD	-8.14%	-12.30%	11.59%	23.90%
IT RMB H	-8.13%	-11.60%	13.64%	40.82%
J	-9.29%	-14.47%	9.58%	148.45%
N2	-9.03%	-14.02%	9.99%	16.13%
NT	-9.02%	-13.96%	9.94%	16.29%
S1	-8.47%	-12.95%	11.30%	74.27%
S1 EUR	2.16%	2.32%	12.47%	111.20%
S1D	-8.49%	-12.94%	11.33%	43.67%
SA	-8.03%	-12.14%	12.33%	30.01%
SHK	-8.02%	-12.12%	12.27%	29.00%
SK	-8.33%	-12.72%	11.62%	134.73%
W	-8.40%	-12.87%	11.11%	-3.48%
W EUR	2.16%	2.28%	12.28%	6.39%
W2	-8.47%	-12.97%	11.35%	0.20%
W2 CHF H	-9.78%	-14.56%	9.82%	-10.80%
W2 EUR H	-9.82%	-14.61%	10.33%	-8.80%
WT	-8.48%	-12.99%	11.21%	0.18%
WT AUD H	-9.31%	-13.94%	10.75%	-5.60%
WT CAD H	-8.75%	-13.25%	10.99%	-5.95%
WT EUR H	-9.69%	-14.48%	10.03%	-9.77%
WT GBP H	-9.15%	-13.66%	10.84%	-7.32%
WT RMB H	-8.03%	-11.44%	13.72%	0.53%

American Income Portfolio

Klasse				
A	-8.60%	-13.08%	4.31%	348.96%
A EUR	1.92%	1.97%	5.40%	124.15%
A2	-8.62%	-13.15%	4.39%	220.45%
A2 CHF H	-9.91%	-14.83%	3.12%	-2.40%
A2 DUR PH	-2.23%	-4.61%	5.42%	19.93%
A2 EUR	1.94%	2.01%	5.46%	122.34%
A2 EUR H	-9.81%	-14.66%	3.38%	16.47%
A2 HKD	-8.23%	-12.37%	4.77%	95.93%
A2 PLN H	-7.06%	-11.26%	3.94%	-2.43%
A2 SGD	-5.83%	-9.75%	3.15%	40.82%
A2 SGD H	-8.82%	-13.32%	4.25%	28.87%
AA	-8.60%	-13.19%	4.41%	18.15%
AA AUD H	-9.25%	-13.83%	4.01%	19.45%
AA CAD H	-8.86%	-13.38%	4.16%	9.27%
AA DUR PH	-2.22%	-4.63%	5.42%	19.01%
AA EUR H	-9.84%	-14.66%	3.37%	-1.83%
AA GBP H	-9.14%	-13.77%	4.06%	4.64%
AA HKD	-8.24%	-12.38%	4.76%	14.99%
AA NZD H	-8.87%	-13.30%	4.16%	18.42%
AA RMB H	-8.23%	-11.68%	6.73%	32.83%
AA SGD H	-8.87%	-13.38%	4.37%	12.94%
AA ZAR H	-7.07%	-9.43%	9.13%	75.54%
AK	-8.63%	-13.16%	4.38%	17.14%
AK EUR	1.97%	2.06%	5.37%	51.75%
AK EUR H	-9.72%	-14.62%	3.38%	1.44%
AR EUR	1.90%	1.99%	5.53%	25.60%
AR EUR H	-9.80%	-14.60%	3.38%	-3.52%
AT	-8.60%	-13.19%	4.46%	147.00%
AT AUD H	-9.24%	-13.87%	3.99%	57.28%
AT CAD H	-8.93%	-13.47%	4.21%	30.53%
AT DUR PH	-2.26%	-4.62%	5.41%	19.85%
AT EUR	1.92%	2.12%	5.42%	138.95%
AT EUR H	-9.76%	-14.63%	3.41%	18.13%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
American Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AT GBP H	-9.19%	-13.70%	3.97%	19.00%
AT HKD	-8.23%	-12.38%	4.79%	95.87%
AT NZD H	-8.84%	-13.27%	4.09%	27.98%
AT RMB H	-8.23%	-11.68%	6.75%	51.95%
AT SGD	-5.84%	-9.73%	3.18%	58.00%
AT SGD H	-8.85%	-13.36%	4.29%	28.77%
B	-8.98%	-13.75%	3.58%	264.87%
B2	-8.94%	-13.76%	3.66%	167.86%
B2 HKD	-8.55%	-12.98%	4.04%	78.31%
BA	-8.96%	-13.78%	3.72%	11.29%
BA AUD H	-9.48%	-14.40%	3.19%	12.22%
BT	-8.89%	-13.73%	3.60%	117.02%
BT AUD H	-9.55%	-14.43%	3.26%	45.11%
BT CAD H	-9.16%	-13.93%	3.39%	18.74%
BT EUR H	-10.12%	-15.23%	2.60%	8.41%
BT GBP H	-9.41%	-14.32%	3.32%	10.94%
BT HKD	-8.55%	-12.98%	4.01%	78.37%
BT NZD H	-9.15%	-13.85%	3.44%	19.79%
C	-8.84%	-13.52%	3.84%	280.97%
C EUR	1.83%	1.65%	4.92%	100.31%
C2	-8.82%	-13.55%	3.90%	280.18%
C2 DUR PH	-2.43%	-5.01%	4.97%	15.00%
C2 EUR	1.72%	1.54%	5.00%	101.05%
C2 EUR H	-9.99%	-15.02%	2.95%	10.53%
CT	-8.88%	-13.56%	3.87%	17.66%
EA	-8.90%	-13.64%	3.90%	-3.16%
EA AUD H	-9.44%	-14.28%	3.42%	-7.94%
EA ZAR H	-7.31%	-9.92%	8.72%	9.17%
I	-8.31%	-12.55%	4.88%	247.55%
I EUR	2.20%	2.53%	5.96%	151.60%
I2	-8.35%	-12.70%	4.98%	103.33%
I2 AUD H	-9.00%	-13.42%	4.60%	-0.20%
I2 CHF H	-9.71%	-14.37%	3.62%	2.93%
I2 DUR PH	-1.94%	-4.05%	5.98%	24.67%
I2 EUR	2.22%	2.59%	6.00%	160.80%
I2 EUR H	-9.55%	-14.16%	3.99%	26.87%
I2 HKD	-7.98%	-11.90%	5.35%	19.23%
I2 SGD	-5.52%	-9.21%	3.69%	49.31%
I2 SGD H	-8.62%	-12.88%	4.83%	15.93%
IA	-8.38%	-12.70%	4.93%	19.46%
IA AUD H	-8.95%	-13.38%	4.60%	16.34%
IT	-8.37%	-12.66%	4.92%	23.54%
IT AUD H	-8.99%	-13.42%	4.57%	24.05%
IT CAD H	-8.63%	-12.88%	4.64%	14.44%
IT EUR H	-9.48%	-14.13%	3.96%	4.15%
IT GBP H	-8.88%	-13.28%	4.64%	10.47%
IT HKD	-7.97%	-11.89%	5.31%	24.44%
IT JPY	10.73%	10.27%	9.00%	68.57%
IT JPY H	-9.44%	-13.89%	4.37%	5.60%
IT NZD H	-8.62%	-12.83%	4.78%	18.95%
IT RMB H	-7.98%	-11.20%	7.27%	2.62%
IT SGD	-5.53%	-9.23%	3.70%	15.93%
IT SGD H	-8.57%	-12.83%	4.87%	22.88%
J	-9.02%	-13.77%	3.60%	174.35%
L2	-8.49%	-12.95%	4.64%	-5.87%
LT	-8.49%	-12.94%	4.68%	-5.87%
N2	-8.88%	-13.67%	3.80%	11.53%
NT	-8.84%	-13.62%	3.77%	11.57%
S	-8.03%	-12.05%	5.69%	32.80%
S1	-8.28%	-12.51%	5.19%	47.73%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
American Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
S1 EUR	2.32%	2.80%	6.29%	100.45%
S1D	-8.29%	-12.51%	5.20%	35.25%
S1D2	-8.27%	-12.50%	5.19%	-7.92%
SA	-8.03%	-12.06%	5.72%	29.22%
SHK	-8.03%	-12.03%	5.67%	22.80%
W	-8.28%	-12.50%	5.06%	5.16%
W2	-8.30%	-12.56%	5.12%	5.33%
W2 CHF H	-9.64%	-14.22%	3.80%	-6.27%
W2 EUR H	-9.44%	-13.97%	4.14%	-4.73%
WT	-8.26%	-12.53%	5.15%	5.39%
WT AUD H	-8.89%	-13.25%	4.71%	0.69%
WT EUR H	-9.47%	-14.02%	4.14%	-7.33%
WT GBP H	-8.89%	-13.17%	4.80%	-5.60%
WT HKD	-7.91%	-11.75%	5.53%	5.73%
WT SGD H	-8.50%	-12.74%	5.01%	2.66%
European Income Portfolio				
Klasse				
A	-8.87%	-13.13%	4.69%	93.65%
A USD	-18.25%	-26.03%	3.59%	77.38%
A2	-8.78%	-13.14%	4.73%	92.30%
A2 CHF H	-8.87%	-13.38%	4.37%	-2.00%
A2 PLN H	-5.99%	-9.69%	5.24%	0.08%
A2 USD	-18.23%	-26.05%	3.65%	78.49%
A2 USD H	-7.64%	-11.73%	5.58%	16.87%
AA	-8.73%	-13.09%	4.66%	9.41%
AA AUD H	-8.26%	-12.45%	5.32%	26.50%
AA HKD H	-8.12%	-12.24%	5.51%	17.22%
AA RMB H	-7.28%	-10.18%	8.02%	32.65%
AA SGD H	-7.84%	-11.91%	5.50%	20.18%
AA USD H	-7.69%	-11.77%	5.62%	24.45%
AK	-8.77%	-13.17%	4.72%	14.33%
AR	-8.75%	-13.14%	4.65%	2.31%
AT	-8.87%	-13.26%	4.84%	88.26%
AT AUD H	-8.26%	-12.48%	5.25%	75.08%
AT SGD H	-7.82%	-11.91%	5.55%	20.18%
AT USD	-18.25%	-26.12%	3.71%	26.06%
AT USD H	-7.69%	-11.78%	5.63%	56.87%
B USD	-18.48%	-26.52%	2.86%	50.14%
B2	-9.05%	-13.75%	4.00%	63.70%
B2 USD	-18.52%	-26.60%	2.94%	49.27%
BA AUD H	-8.58%	-13.03%	4.59%	19.31%
BA USD H	-8.02%	-12.35%	4.84%	17.36%
BT	-9.08%	-13.76%	4.11%	65.35%
BT AUD H	-8.65%	-13.03%	4.52%	61.63%
BT USD H	-8.06%	-12.44%	4.90%	44.25%
C	-8.95%	-13.41%	4.21%	71.27%
C USD	-18.35%	-26.31%	3.12%	57.90%
C2	-8.95%	-13.52%	4.23%	81.10%
C2 USD	-18.42%	-26.40%	3.17%	68.05%
C2 USD H	-7.86%	-12.14%	5.16%	11.00%
CK	-8.96%	-13.51%	4.24%	9.87%
CT USD H	-7.93%	-12.22%	5.18%	11.01%
I	-8.59%	-12.62%	5.25%	120.47%
I USD	-17.96%	-25.55%	4.15%	165.66%
I2	-8.54%	-12.67%	5.32%	73.26%
I2 AUD H	-8.06%	-12.01%	5.81%	87.00%
I2 CHF H	-8.56%	-12.90%	3.35%	0.40%
I2 USD	-17.95%	-25.63%	4.22%	36.73%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
European Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
I2 USD H	-7.42%	-11.28%	6.24%	67.27%
IA	-8.49%	-12.64%	5.31%	7.57%
IA HKD H	-7.82%	-11.72%	6.07%	18.32%
IA SGD H	-7.55%	-11.37%	6.13%	18.74%
IA USD H	-7.42%	-11.25%	6.18%	22.30%
IT	-8.48%	-12.65%	5.29%	7.47%
IT SGD H	-7.60%	-11.44%	6.16%	18.79%
IT USD H	-7.45%	-11.31%	6.25%	24.63%
NT USD H	-7.99%	-12.29%	5.07%	4.31%
S1	-8.40%	-12.47%	5.52%	54.58%
S1 USD	-17.90%	-25.48%	4.40%	15.19%
S1 USD H	-7.28%	-11.06%	6.43%	57.07%
S1D	-8.44%	-12.50%	5.51%	9.49%
SA USD H	-7.10%	-10.65%	6.94%	37.16%
SHK	-8.15%	-12.01%	6.02%	12.97%
W2	-8.45%	-12.52%	5.41%	-6.80%
W2 CHF H	-8.51%	-12.75%	5.12%	-3.27%
W2 USD H	-7.35%	-11.12%	6.40%	-2.47%
WA	-8.42%	-12.51%	5.46%	-6.79%
WA HKD H	-7.75%	-11.56%	6.25%	-3.00%
WA USD H	-7.37%	-11.12%	6.32%	-2.52%
WT	-8.40%	-12.51%	5.45%	-6.77%
WT SGD H	-7.51%	-11.26%	6.33%	-3.44%
WT USD H	-7.43%	-11.21%	6.46%	-2.52%

Emerging Markets Debt Portfolio

Klasse				
A	-11.59%	-23.30%	5.90%	83.98%
A EUR	-1.30%	-9.90%	7.04%	119.31%
A2	-11.57%	-23.35%	6.01%	84.87%
A2 CHF H	-12.76%	-24.79%	4.57%	-17.47%
A2 EUR	-1.32%	-9.95%	7.10%	120.37%
A2 EUR H	-12.74%	-24.79%	4.84%	11.87%
A2 HKD	-11.19%	-22.66%	6.38%	39.78%
A2 PLN	-1.01%	-5.95%	-	-3.54%
A2 PLN H	-10.49%	-22.30%	4.99%	-14.46%
A2 SGD H	-11.83%	-23.59%	5.79%	15.33%
AA	-11.56%	-23.34%	6.02%	6.67%
AA AUD H	-12.30%	-24.06%	5.38%	5.12%
AA CAD H	-11.93%	-23.65%	5.54%	-5.28%
AA EUR H	-12.77%	-24.80%	4.76%	-13.86%
AA GBP H	-12.18%	-23.97%	5.35%	-8.87%
AA HKD	-11.20%	-22.66%	6.40%	2.05%
AA NZD H	-12.10%	-23.66%	5.63%	1.60%
AA RMB H	-11.27%	-22.09%	8.25%	19.24%
AA SGD H	-11.85%	-23.59%	5.84%	1.34%
AA ZAR H	-10.15%	-20.15%	10.48%	54.21%
AI	-11.56%	-23.37%	-	-20.02%
AI AUD H	-12.37%	-24.12%	-	-20.98%
AR EUR	-1.29%	-9.84%	7.10%	15.27%
AT	-11.53%	-23.31%	5.99%	84.82%
AT AUD H	-12.36%	-24.11%	5.32%	42.83%
AT CAD H	-11.88%	-23.63%	5.62%	-4.11%
AT EUR	-1.29%	-9.92%	7.13%	114.92%
AT EUR H	-12.79%	-24.84%	4.82%	12.07%
AT GBP H	-12.24%	-23.96%	5.36%	-7.94%
AT HKD	-11.18%	-22.65%	6.39%	39.79%
AT NZD H	-12.04%	-23.64%	5.55%	7.07%
AT SGD H	-11.81%	-23.56%	5.81%	15.28%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
B2 HKD	-11.63%	-23.42%	5.33%	23.01%
BT	-11.97%	-24.08%	4.92%	56.78%
C	-11.76%	-23.69%	5.50%	71.06%
C EUR	-1.55%	-10.33%	6.56%	103.83%
C2	-11.76%	-23.70%	5.51%	71.53%
C2 EUR	-1.54%	-10.33%	6.57%	104.47%
C2 EUR H	-12.90%	-25.13%	4.41%	6.27%
CT	-11.77%	-23.69%	5.53%	-3.55%
EA	-11.77%	-23.71%	5.42%	-17.47%
EA AUD H	-12.61%	-24.46%	4.74%	-21.24%
EA ZAR H	-10.37%	-20.55%	9.98%	-8.82%
EI	-11.79%	-23.73%	-	-20.63%
EI AUD H	-12.61%	-24.50%	-	-21.58%
I	-11.36%	-22.93%	6.56%	101.20%
I2	-11.34%	-22.94%	6.58%	102.20%
I2 AUD H	-7.07%(4)	-	-	-7.07%
I2 CHF H	-12.53%	-24.38%	5.11%	-12.93%
I2 EUR	-1.08%	-9.45%	7.69%	141.05%
I2 EUR H	-12.52%	-24.37%	5.44%	20.20%
IT AUD H	-12.16%	-23.73%	6.01%	6.02%
IT EUR H	-12.57%	-24.42%	5.41%	-10.47%
N2	-11.77%	-23.77%	5.42%	-5.07%
NT	-11.85%	-23.76%	5.44%	-5.06%
S	-11.02%	-22.41%	7.33%	43.89%
S1 2	-11.27%	-22.84%	6.72%	87.87%
S1 2 EUR	-0.95%	-9.28%	7.85%	163.47%
S1 EUR H	-12.44%	-24.26%	5.69%	16.33%
S1 GBP H	-11.85%	-23.36%	6.19%	24.47%
SA	-11.02%	-22.41%	7.32%	16.31%

Mortgage Income Portfolio

Klasse				
A	-1.67%	-2.66%	7.58%	18.46%
A2	-1.71%	-2.73%	7.63%	18.87%
A2 EUR	9.71%	14.30%	8.76%	62.31%
A2 HKD	-1.27%	-1.83%	8.04%	5.28%
A2 SGD	1.34%	1.09%	6.38%	31.54%
A2X	-1.62%	-2.67%	7.71%	34.38%
A2X EUR	9.66%	14.30%	8.81%	18.12%
AA	-1.69%	-2.78%	7.61%	18.83%
AA AUD H	-2.10%	-3.25%	7.13%	20.13%
AA HKD	-1.27%	-1.85%	7.96%	17.58%
AA RMB H	-1.13%	-0.93%	10.06%	31.46%
AA SGD H	-1.84%	-2.80%	7.52%	16.20%
AA ZAR H	0.35%	1.90%	12.60%	81.27%
AR EUR H	-2.66%	-4.00%	6.65%	0.18%
AT	-1.66%	-2.71%	7.60%	18.76%
AT AUD H	-2.11%	-3.25%	7.20%	20.20%
AT EUR	9.69%	14.29%	8.72%	62.14%
AT GBP H	-1.97%	-3.09%	7.28%	-3.46%
AT HKD	-1.26%	-1.85%	8.00%	5.17%
AT SGD	1.36%	1.13%	6.34%	31.47%
AT SGD H	-1.80%	-2.89%	7.61%	15.95%
AX	-1.78%	-2.67%	7.75%	73.95%
AX EUR	9.88%	14.38%	8.91%	42.27%
BX	-2.02%	-3.12%	7.25%	53.20%
BX EUR	9.46%	13.69%	8.42%	2.17%
C	-1.91%	-3.19%	7.17%	13.98%
C2	-1.95%	-3.17%	7.15%	14.20%

<u>Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)</u>	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Klasse				
C2 EUR.....	9.44%	13.82%	8.24%	55.99%
CX.....	-2.02%	-3.12%	7.25%	53.07%
I.....	-1.38%	-2.18%	8.19%	24.31%
I EUR.....	9.90%	14.83%	9.22%	69.37%
I2.....	-1.43%	-2.20%	8.21%	24.53%
I2 EUR.....	10.00%	14.97%	9.33%	70.08%
I2 EUR H.....	-2.44%	-3.55%	7.18%	-4.00%
IT EUR H.....	-2.53%	-3.67%	7.21%	-4.70%
IX.....	-1.49%	-2.11%	8.36%	70.73%
N2.....	-1.97%	-3.31%	7.08%	-0.60%
NT.....	-2.01%	-3.33%	7.05%	-0.52%
S.....	-1.02%	-1.48%	9.08%	32.46%
S1.....	-1.36%	-2.03%	8.42%	26.87%
S1 EUR.....	10.11%	15.16%	9.54%	72.97%
S1 EUR H.....	-2.43%	-3.47%	7.41%	-5.84%
S1 JPY.....	19.23%	23.73%	12.62%	27.33%
SA.....	-1.10%	-1.56%	8.97%	29.39%

Die Wertentwicklung der Anteilklassen der einzelnen Portefeuilles basiert auf dem Nettoinventarwert zum 31. August 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 Anteilklassen umfasst die während des Geschäftsjahres 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 31. August 2022.

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) 24. Juni 2022.
- (4) 2. Juni 2022.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Charter Communications, Inc. - Class A	254	\$ 104,808	0.3%
Comcast Corp. - Class A	5,568	201,506	0.6
Deutsche Telekom AG (REG)	3,120	58,803	0.2
Liberty Global PLC - Class C	684	14,576	0.0
Spark New Zealand Ltd.	16,590	54,878	0.2
Telefonica SA	10,589	43,701	0.1
Telenor ASA	547	5,986	0.0
		<u>484,258</u>	<u>1.4</u>
UNTERHALTUNG			
Electronic Arts, Inc.	1,628	206,544	0.6
Roku, Inc.	125	8,500	0.0
Walt Disney Co. (The)	905	101,433	0.3
		<u>316,477</u>	<u>0.9</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class A	807	87,334	0.2
Alphabet, Inc. - Class C	2,450	267,417	0.7
Meta Platforms, Inc. - Class A	1,528	248,957	0.8
		<u>603,708</u>	<u>1.7</u>
		<u>1,404,443</u>	<u>4.0</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Aptiv PLC	1,482	138,463	0.4
Faurecia SE	2,010	28,825	0.1
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	3,320	46,580	0.1
		<u>213,868</u>	<u>0.6</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Nissan Motor Co., Ltd.	2,900	11,409	0.0
Stellantis NV	4,515	60,093	0.2
Tesla, Inc.	309	85,163	0.2
Toyota Motor Corp.	1,100	16,462	0.1
		<u>173,127</u>	<u>0.5</u>
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
ADT, Inc.	8,516	62,082	0.2
Service Corp. International/US	83	5,122	0.0
		<u>67,204</u>	<u>0.2</u>
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Aristocrat Leisure Ltd.	1,078	26,019	0.1
Booking Holdings, Inc.	24	45,020	0.1
Chipotle Mexican Grill, Inc.	12	19,162	0.1
Compass Group PLC	9,161	197,063	0.5
Entain PLC	4,050	59,586	0.2
Galaxy Entertainment Group Ltd.	16,500	92,230	0.3
Marriott International, Inc./MD - Class A	343	52,733	0.1
Starbucks Corp.	1,605	134,932	0.4
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	25,500	52,228	0.1
Yum China Holdings, Inc.	622	31,168	0.1
		<u>710,141</u>	<u>2.0</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
DR Horton, Inc.	135	9,605	0.0
Midea Group Co., Ltd. - Class A	5,400	41,349	0.1
PulteGroup, Inc.	2,068	84,085	0.3
		<u>135,039</u>	<u>0.4</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	3,800	45,336	0.1
Alibaba Group Holding Ltd. (ADR)	656	62,589	0.2
Amazon.com, Inc.	3,197	405,283	1.2
eBay, Inc.	1,000	44,130	0.1
Prosus NV	1,156	71,452	0.2
		<u>628,790</u>	<u>1.8</u>
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Dollarama, Inc.	284	17,295	0.0
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
AutoZone, Inc.	18	38,146	0.1
O'Reilly Automotive, Inc.	25	17,428	0.0

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
TJX Cos., Inc. (The)	1,605	\$ 100,072	0.3%
Ulta Beauty, Inc.	129	54,163	0.2
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	7,100	33,571	0.1
		<u>243,380</u>	<u>0.7</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
adidas AG	162	24,022	0.1
Carter's, Inc.	905	66,834	0.2
Kering SA	66	33,116	0.1
NIKE, Inc. - Class B	1,295	137,853	0.3
Tapestry, Inc.	1,850	64,250	0.2
		<u>326,075</u>	<u>0.9</u>
		<u>2,514,919</u>	<u>7.1</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Asahi Group Holdings Ltd.	4,960	166,300	0.5
Coca-Cola Co. (The)	2,846	175,627	0.5
Constellation Brands, Inc. - Class A	815	200,531	0.5
PepsiCo, Inc.	169	29,113	0.1
		<u>571,571</u>	<u>1.6</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Atacadao SA	11,200	42,519	0.1
Costco Wholesale Corp.	103	53,776	0.1
Kroger Co. (The)	459	22,005	0.1
		<u>118,300</u>	<u>0.3</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Archer-Daniels-Midland Co.	696	61,171	0.2
Bunge Ltd.	179	17,751	0.1
Campbell Soup Co.	158	7,960	0.0
Hain Celestial Group, Inc. (The)	1,950	39,507	0.1
Nestle SA	2,201	257,568	0.7
Nomad Foods Ltd.	2,200	38,918	0.1
Salmar ASA	685	45,297	0.1
Tyson Foods, Inc. - Class A	615	46,359	0.1
		<u>514,531</u>	<u>1.4</u>
HAUSHALTSPRODUKTE			
Colgate-Palmolive Co.	715	55,920	0.2
TABAK			
Imperial Brands PLC	2,473	54,386	0.2
		<u>1,314,708</u>	<u>3.7</u>
ENERGIE			
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE			
Baker Hughes Co.	1,290	32,585	0.1
Halliburton Co.	1,530	46,099	0.1
		<u>78,684</u>	<u>0.2</u>
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
Cameco Corp.	1,950	56,842	0.2
Cheniere Energy, Inc.	250	40,045	0.1
ConocoPhillips	625	68,406	0.2
EOG Resources, Inc.	385	46,700	0.1
Equinor ASA	1,522	59,070	0.2
Exxon Mobil Corp.	41	3,919	0.0
Marathon Petroleum Corp.	434	43,726	0.1
Neste Oyj	650	32,069	0.1
Shell PLC	11,875	314,355	0.9
Woodside Energy Group Ltd.	690	16,028	0.0
		<u>681,160</u>	<u>1.9</u>
		<u>759,844</u>	<u>2.1</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
ABN AMRO Bank NV (GDR)	3,587	34,460	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	1,108	4,972	0.0
Bank Leumi Le-Israel BM	4,650	49,156	0.1
Bank of Ireland Group PLC	10,370	63,895	0.2
BNP Paribas SA	433	20,122	0.1
Citigroup, Inc.	818	39,927	0.1
HDFC Bank Ltd. (ADR)	2,280	139,194	0.4
HSBC Holdings PLC	10,543	64,595	0.2
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A	15,100	37,247	0.1
JPMorgan Chase & Co.	449	51,065	0.2
KB Financial Group, Inc.	1,460	53,595	0.2

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KeyCorp	2,893	\$ 51,177	0.2%
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	16,600	86,053	0.2
National Bank of Canada	638	42,209	0.1
Natwest Group PLC	22,666	64,681	0.2
Regions Financial Corp.	1,882	40,783	0.1
Royal Bank of Canada	115	10,694	0.0
Societe Generale SA	1,796	39,594	0.1
Standard Chartered PLC	6,338	43,898	0.1
Wells Fargo & Co.	3,505	153,204	0.4
		<u>1,090,521</u>	<u>3.1</u>
KAPITALMÄRKTE			
Ameriprise Financial, Inc.	207	55,478	0.2
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	12,600	28,700	0.1
BlackRock, Inc.	210	139,942	0.4
Carlyle Group, Inc. (The)	1,224	39,817	0.1
Charles Schwab Corp. (The)	3,403	241,443	0.7
Credit Suisse Group AG (REG)	12,770	65,895	0.2
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	631	209,914	0.5
Julius Baer Group Ltd.	1,544	74,606	0.2
London Stock Exchange Group PLC	294	27,578	0.1
Moody's Corp.	87	24,753	0.1
		<u>908,126</u>	<u>2.6</u>
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Berkshire Hathaway, Inc. - Class B	18	5,054	0.0
Eurazeo SE	466	27,830	0.1
		<u>32,884</u>	<u>0.1</u>
VERSICHERUNGEN			
AIA Group Ltd.	13,400	128,925	0.4
Aon PLC	210	58,645	0.2
Everest Re Group Ltd.	127	34,169	0.1
Fidelity National Financial, Inc.	1,186	46,373	0.1
Japan Post Holdings Co., Ltd.	2,200	15,177	0.0
Japan Post Insurance Co., Ltd.	3,000	45,953	0.1
Medibank Pvt Ltd.	22,341	56,276	0.2
NN Group NV	427	17,549	0.0
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	9,300	54,699	0.2
Suncorp Group Ltd.	9,580	70,751	0.2
Willis Towers Watson PLC	212	43,848	0.1
		<u>572,365</u>	<u>1.6</u>
		<u>2,603,896</u>	<u>7.4</u>
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
AbbVie, Inc.	52	6,992	0.0
Amgen, Inc.	165	39,649	0.1
Genmab A/S	384	136,691	0.4
Moderna, Inc.	191	25,264	0.1
		<u>208,596</u>	<u>0.6</u>
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Abbott Laboratories	1,389	142,581	0.4
Demant A/S	778	23,966	0.1
Hologic, Inc.	588	39,725	0.1
Koninklijke Philips NV	2,772	46,037	0.1
Medtronic PLC	1,739	152,893	0.4
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	590	62,729	0.2
		<u>467,931</u>	<u>1.3</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
AmerisourceBergen Corp.	383	56,133	0.1
Centene Corp.	1,369	122,854	0.3
Elevance Health, Inc.	280	135,831	0.4
McKesson Corp.	76	27,892	0.1
Molina Healthcare, Inc.	171	57,690	0.2
UnitedHealth Group, Inc.	131	68,032	0.2
		<u>468,432</u>	<u>1.3</u>
GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE			
Change Healthcare, Inc.	3,340	82,064	0.3
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
IQVIA Holdings, Inc.	859	182,675	0.5
Lonza Group AG	177	94,398	0.3
Mettler-Toledo International, Inc.	42	50,923	0.1
Thermo Fisher Scientific, Inc.	170	92,704	0.3
Waters Corp.	163	48,672	0.1
		<u>469,372</u>	<u>1.3</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
PHARMAZEUTIKA			
Bayer AG (REG)	644	\$ 34,060	0.1%
Eli Lilly & Co.	258	77,717	0.2
Johnson & Johnson	373	60,180	0.2
Merck & Co., Inc.	202	17,243	0.0
Novo Nordisk A/S - Class B	1,530	163,579	0.5
Pfizer, Inc.	1,371	62,010	0.2
Roche Holding AG (BR)	43	16,424	0.0
Roche Holding AG (Genusschein)	929	299,362	0.9
Sanofi	1,962	160,393	0.4
Zoetis, Inc.	866	135,555	0.4
		<u>1,026,523</u>	<u>2.9</u>
		<u>2,722,918</u>	<u>7.7</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Airbus SE	807	79,081	0.2
BAE Systems PLC	3,293	29,657	0.1
Huntington Ingalls Industries, Inc.	240	55,262	0.2
Spirit AeroSystems Holdings, Inc. - Class A	1,300	39,130	0.1
		<u>203,130</u>	<u>0.6</u>
LUFTFRACHT UND LOGISTIK			
CH Robinson Worldwide, Inc.	502	57,303	0.2
Nippon Express Holdings, Inc.	900	49,521	0.1
United Parcel Service, Inc. - Class B	159	30,927	0.1
		<u>137,751</u>	<u>0.4</u>
FLUGGESELLSCHAFTEN			
Southwest Airlines Co.	173	6,349	0.0
BAUPRODUKTE			
Otis Worldwide Corp.	2,417	174,556	0.5
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Copart, Inc.	170	20,340	0.0
MillerKnoll, Inc.	1,050	29,064	0.1
TOPPAN, Inc.	1,300	20,416	0.1
		<u>69,820</u>	<u>0.2</u>
BAU- UND INGENIEURWESEN			
AECOM	870	63,641	0.2
Dycom Industries, Inc.	207	23,209	0.1
Epiroc AB Class B	639	8,699	0.0
		<u>95,549</u>	<u>0.3</u>
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Eaton Corp. PLC	844	115,324	0.3
Regal Rexnord Corp.	645	88,745	0.2
Vertiv Holdings Co.	4,720	54,422	0.2
		<u>258,491</u>	<u>0.7</u>
MASCHINEN			
Alstom SA	7,008	143,617	0.4
Amada Co., Ltd.	8,200	64,160	0.2
Dover Corp.	595	74,351	0.2
Parker-Hannifin Corp.	328	86,920	0.2
Snap-on, Inc.	243	52,940	0.2
Techtronic Industries Co., Ltd.	400	4,718	0.0
Volvo AB - Class B	4,071	64,486	0.2
		<u>491,192</u>	<u>1.4</u>
SCHIFFFAHRT			
AP Moller - Maersk A/S - Class A	14	32,706	0.1
Kuehne & Nagel International AG (REG)	178	41,138	0.1
SITC International Holdings Co., Ltd.	15,000	38,037	0.1
		<u>111,881</u>	<u>0.3</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Booz Allen Hamilton Holding Corp.	153	14,642	0.0
Recruit Holdings Co., Ltd.	3,310	105,227	0.3
Robert Half International, Inc.	658	50,646	0.2
		<u>170,515</u>	<u>0.5</u>
STRASSE UND SCHIENE			
Aurizon Holdings Ltd.	745	1,884	0.0
XPO Logistics, Inc.	1,220	63,953	0.2
		<u>65,837</u>	<u>0.2</u>
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Ashtead Group PLC	2,727	133,972	0.4

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Ferguson PLC	453	\$ 52,461	0.1%
WW Grainger, Inc.	25	13,873	0.0
		<u>200,306</u>	<u>0.5</u>
		<u>1,985,377</u>	<u>5.6</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSTRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Murata Manufacturing Co., Ltd.	1,920	103,385	0.3
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Akamai Technologies, Inc.	992	89,558	0.2
Automatic Data Processing, Inc.	1,017	248,565	0.7
BIPROGY, Inc.	2,100	46,508	0.1
Capgemini SE	923	159,474	0.4
Cognizant Technology Solutions Corp. - Class A	2,051	129,562	0.4
Gartner, Inc.	194	55,352	0.2
Mastercard, Inc. - Class A	867	281,229	0.8
PayPal Holdings, Inc.	1,467	137,076	0.4
Shopify, Inc. - Class A	148	4,685	0.0
Visa, Inc. - Class A	1,552	308,398	0.9
		<u>1,460,407</u>	<u>4.1</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Advanced Micro Devices, Inc.	375	31,826	0.1
Applied Materials, Inc.	873	82,123	0.2
ASML Holding NV	318	155,220	0.4
Broadcom, Inc.	118	58,895	0.2
Infineon Technologies AG	1,186	29,020	0.1
Novatek Microelectronics Corp.	3,230	27,634	0.1
NVIDIA Corp.	355	53,584	0.2
NXP Semiconductors NV	260	42,791	0.1
QUALCOMM, Inc.	489	64,680	0.2
STMicroelectronics NV	1,120	39,032	0.1
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	5,310	86,924	0.2
		<u>671,729</u>	<u>1.9</u>
SOFTWARE			
ACI Worldwide, Inc.	1,530	36,261	0.1
Adobe, Inc.	132	49,294	0.1
Autodesk, Inc.	127	25,621	0.1
Cadence Design Systems, Inc.	320	55,606	0.2
CommVault Systems, Inc.	1,146	62,216	0.2
Dropbox, Inc. - Class A	1,219	26,075	0.1
Fortinet, Inc.	950	46,256	0.1
Microsoft Corp.	2,896	757,217	2.1
NortonLifeLock, Inc.	2,250	50,828	0.1
Oracle Corp.	1,620	120,123	0.3
Palo Alto Networks, Inc.	56	31,181	0.1
SAP SE	1,870	159,267	0.5
ServiceNow, Inc.	117	50,851	0.2
Zoom Video Communications, Inc. - Class A	156	12,542	0.0
		<u>1,483,338</u>	<u>4.2</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	1,912	300,605	0.8
Ricoh Co., Ltd.	6,200	48,728	0.1
Samsung Electronics Co., Ltd.	4,501	199,398	0.6
Western Digital Corp.	1,550	65,503	0.2
		<u>614,234</u>	<u>1.7</u>
		<u>4,333,093</u>	<u>12.2</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
CF Industries Holdings, Inc.	222	22,968	0.1
Linde PLC	254	71,847	0.2
LyondellBasell Industries NV - Class A	405	33,615	0.1
Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	2,100	11,025	0.0
OCI NV	1,493	56,051	0.2
Sika AG	358	80,548	0.2
Sumitomo Chemical Co., Ltd.	12,600	49,598	0.1
		<u>325,652</u>	<u>0.9</u>
CONTAINER UND VERPACKUNGEN			
Packaging Corp. of America	31	4,244	0.0
Sealed Air Corp.	944	50,797	0.2
		<u>55,041</u>	<u>0.2</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %	
METALL UND BERGBAU						
ArcelorMittal SA			2,840	\$ 67,405	0.2%	
BHP Group Ltd.			195	5,320	0.0	
Endeavour Mining PLC			2,078	40,461	0.1	
Teck Resources Ltd. - Class B			563	19,067	0.1	
				<u>132,253</u>	<u>0.4</u>	
STAHL						
ATI, Inc.			1,700	50,881	0.1	
				<u>563,827</u>	<u>1.6</u>	
IMMOBILIEN						
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)						
American Tower Corp.			688	174,787	0.5	
Americold Realty Trust, Inc.			2,310	67,960	0.2	
Iron Mountain, Inc.			913	48,033	0.1	
Land Securities Group PLC			1,746	13,169	0.0	
Weyerhaeuser Co.			1,545	52,777	0.2	
				<u>356,726</u>	<u>1.0</u>	
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG						
CBRE Group, Inc. - Class A			1,333	105,254	0.3	
CIFI Holdings Group Co., Ltd.			100,960	25,552	0.1	
Nomura Real Estate Holdings, Inc.			1,600	39,309	0.1	
				<u>170,115</u>	<u>0.5</u>	
				<u>526,841</u>	<u>1.5</u>	
VERSORGUNG						
STROMVERSORGBETRIEBE						
EDP - Energias de Portugal SA			17,251	82,384	0.2	
Endesa SA			514	8,816	0.0	
Enel SpA			13,230	62,168	0.2	
Iberdrola SA			4,969	51,736	0.1	
NRG Energy, Inc.			1,432	59,113	0.2	
				<u>264,217</u>	<u>0.7</u>	
GASVERSORGBETRIEBE						
China Resources Gas Group Ltd.			8,400	32,704	0.1	
Kunlun Energy Co., Ltd.			78,000	67,917	0.2	
Naturgy Energy Group SA			1,810	49,910	0.1	
UGI Corp.			1,276	50,402	0.2	
				<u>200,933</u>	<u>0.6</u>	
MEHRFACH-VERSORGBETRIEBE						
Sempra Energy			150	24,746	0.1	
				<u>489,896</u>	<u>1.4</u>	
				<u>19,219,762</u>	<u>54.3</u>	
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE						
AUSTRALIEN						
Australia Government Bond, Series 136	4.75%	04/21/2027	AUD	480	348,205	1.0
Australia Government Bond, Series 144	3.75%	04/21/2037		60	40,773	0.1
					<u>388,978</u>	<u>1.1</u>
ÖSTERREICH						
Republic of Austria Government Bond	0.00%	02/20/2030	EUR	53	46,017	0.1
Republic of Austria Government Bond	0.00%	02/20/2031		120	101,511	0.3
Republic of Austria Government Bond	0.90%	02/20/2032		246	220,630	0.6
					<u>368,158</u>	<u>1.0</u>
BELGIEN						
Kingdom of Belgium Government Bond, Series 84	1.45%	06/22/2037		63	55,199	0.1
KANADA						
Canadian Government Bond	2.00%	12/01/2051	CAD	95	57,950	0.1
Canadian Government Bond	2.25%	12/01/2029		40	28,747	0.1
					<u>86,697</u>	<u>0.2</u>
DEUTSCHLAND						
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	02/15/2032	EUR	291	254,418	0.7
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	08/15/2050		190	121,825	0.3
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.25%	02/15/2029		290	271,943	0.8
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	3.25%	07/04/2042		156	199,935	0.6
					<u>848,121</u>	<u>2.4</u>
INDONESIEN						
Indonesia Treasury Bond, Series FR87	6.50%	02/15/2031	IDR	986,000	64,039	0.2
IRLAND						
Ireland Government Bond	0.00%	10/18/2031	EUR	205	170,800	0.5

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ITALIEN					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	0.25%	03/15/2028	EUR 206	\$ 176,419	0.5%
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1.50%	04/30/2045	34	21,859	0.1
				<u>198,278</u>	<u>0.6</u>
JAPAN					
Japan Government Five Year Bond, Series 138	0.10%	12/20/2023	JPY 64,800	467,716	1.3
Japan Government Ten Year Bond, Series 332	0.60%	12/20/2023	52,750	383,216	1.1
Japan Government Thirty Year Bond, Series 65	0.40%	12/20/2049	11,350	67,530	0.2
Japan Government Thirty Year Bond, Series 68	0.60%	09/20/2050	9,250	57,675	0.1
Japan Government Thirty Year Bond, Series 74	1.00%	03/20/2052	4,350	29,838	0.1
Japan Government Twenty Year Bond, Series 171	0.30%	12/20/2039	10,350	69,163	0.2
Japan Government Twenty Year Bond, Series 177	0.40%	06/20/2041	19,800	132,126	0.4
Japan Government Twenty Year Bond, Series 180	0.80%	03/20/2042	6,800	48,536	0.1
Japan Government Two Year Bond, Series 430	0.01%	11/01/2023	63,950	461,019	1.3
Japan Government Two Year Bond, Series 433	0.01%	02/01/2024	8,650	62,366	0.2
				<u>1,779,185</u>	<u>5.0</u>
MALAYSIA					
Malaysia Government Bond, Series 310	4.50%	04/15/2030	MYR 245	56,514	0.2
SPANIEN					
Spain Government Bond	2.55%	10/31/2032	EUR 190	187,864	0.5
THAILAND					
Thailand Government Bond	1.59%	12/17/2035	THB 1,100	25,306	0.1
VEREINIGTES KÖNIGREICH					
United Kingdom Gilt	0.88%	01/31/2046	GBP 25	18,088	0.1
United Kingdom Gilt	1.25%	07/31/2051	33	24,840	0.1
United Kingdom Gilt	1.50%	07/31/2053	12	9,729	0.0
United Kingdom Gilt	1.75%	09/07/2037	167	160,971	0.4
				<u>213,628</u>	<u>0.6</u>
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds	1.13%	08/15/2040	USD 537	363,566	1.0
U.S. Treasury Bonds	1.75%	08/15/2041	47	35,059	0.1
U.S. Treasury Bonds	1.88%	02/15/2051	224	163,784	0.5
U.S. Treasury Bonds	2.00%	08/15/2051	155	116,952	0.3
U.S. Treasury Bonds	2.38%	02/15/2042	58	48,285	0.2
U.S. Treasury Notes	0.25%	03/15/2024	159	151,373	0.4
U.S. Treasury Notes	0.25%	05/31/2025	113	103,409	0.3
U.S. Treasury Notes	0.38%	04/15/2024	115	109,412	0.3
U.S. Treasury Notes	0.38%	07/15/2024	6	5,574	0.0
U.S. Treasury Notes	0.38%	09/15/2024	311	292,243	0.8
U.S. Treasury Notes	0.50%	11/30/2023	460	443,541	1.3
U.S. Treasury Notes	1.50%	01/31/2027	159	146,649	0.4
U.S. Treasury Notes	2.13%	05/31/2026	180	171,872	0.5
U.S. Treasury Notes	2.25%	02/15/2027	333	317,070	0.9
U.S. Treasury Notes	2.75%	08/15/2032	370	357,975	1.0
U.S. Treasury Notes	2.88%	05/15/2032	35	34,212	0.1
				<u>2,860,976</u>	<u>8.1</u>
				<u>7,303,743</u>	<u>20.6</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Banco de Credito del Peru S.A.	3.13%	07/01/2030	40	36,800	0.1
Banco Santander SA	1.13%	06/23/2027	EUR 100	90,838	0.3
Bank of America Corp.	2.88%	10/22/2030	USD 6	5,213	0.0
Bank of America Corp.	3.19%	07/23/2030	6	5,340	0.0
Bank of America Corp.	3.42%	12/20/2028	11	10,208	0.0
Bank of America Corp.	3.56%	04/23/2027	45	42,886	0.1
Bank of America Corp.	3.97%	02/07/2030	6	5,622	0.0
Barclays PLC	0.58%	08/09/2029	EUR 100	80,661	0.2
Capital One Financial Corp.	4.93%	05/10/2028	USD 30	29,645	0.1
Citigroup, Inc.	3.98%	03/20/2030	45	42,045	0.1
Citigroup, Inc.	4.08%	04/23/2029	27	25,688	0.1
Credit Suisse AG/London	0.25%	01/05/2026	EUR 100	89,401	0.3
Danske Bank A/S	0.75%	06/09/2029	100	83,173	0.2
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	2.60%	02/07/2030	USD 28	23,973	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	2.64%	02/24/2028	46	41,729	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	3.62%	03/15/2028	5	4,730	0.0
HSBC Holdings PLC	5.21%	08/11/2028	200	196,453	0.6
JPMorgan Chase & Co.	4.57%	06/14/2030	47	45,726	0.1
JPMorgan Chase & Co.	4.85%	07/25/2028	24	23,973	0.1
Morgan Stanley	0.41%	10/29/2027	EUR 100	88,864	0.2
Nationwide Building Society	3.25%	09/05/2029	100	98,777	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Santander Holdings USA, Inc.....	2.49%	01/06/2028	USD 37	\$ 32,173	0.1%
State Street Corp.....	4.16%	08/04/2033	72	69,577	0.2
US Bancorp, Series J(a).....	5.30%	04/15/2027	27	24,058	0.1
				<u>1,197,553</u>	<u>3.4</u>
MAKLER					
Charles Schwab Corp. (The), Series I(a).....	4.00%	06/01/2026	38	32,940	0.1
SURA Asset Management SA.....	4.88%	04/17/2024	100	98,987	0.2
				<u>131,927</u>	<u>0.3</u>
FINANZEN					
Air Lease Corp.....	2.10%	09/01/2028	3	2,464	0.0
Air Lease Corp.....	3.25%	03/01/2025	2	1,917	0.0
Air Lease Corp.....	3.63%	04/01/2027	9	8,338	0.0
Aircastle Ltd.....	5.25%	08/11/2025	22	21,194	0.1
Aviation Capital Group LLC.....	1.95%	01/30/2026	9	7,768	0.0
Aviation Capital Group LLC.....	1.95%	09/20/2026	14	11,747	0.0
Aviation Capital Group LLC.....	4.13%	08/01/2025	13	12,155	0.0
Synchrony Financial.....	2.88%	10/28/2031	27	20,828	0.1
Synchrony Financial.....	3.95%	12/01/2027	15	13,643	0.1
				<u>100,054</u>	<u>0.3</u>
VERSICHERUNGEN					
Prudential Financial, Inc.....	5.63%	06/15/2043	20	19,922	0.1
REITs					
American Tower Corp.....	3.65%	03/15/2027	15	14,264	0.0
American Tower Corp.....	4.05%	03/15/2032	10	9,190	0.0
Equinix, Inc.....	2.63%	11/18/2024	29	27,942	0.1
Essential Properties LP.....	2.95%	07/15/2031	38	29,180	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.....	3.25%	01/15/2032	15	12,141	0.0
Highwoods Realty LP.....	2.60%	02/01/2031	35	27,841	0.1
Host Hotels & Resorts LP, Series I.....	3.50%	09/15/2030	10	8,453	0.0
Host Hotels & Resorts LP, Series J.....	2.90%	12/15/2031	24	18,693	0.1
Office Properties Income Trust.....	3.45%	10/15/2031	19	12,603	0.0
Omega Healthcare Investors, Inc.....	3.25%	04/15/2033	19	14,465	0.1
Omega Healthcare Investors, Inc.....	3.63%	10/01/2029	5	4,266	0.0
				<u>179,038</u>	<u>0.5</u>
				<u>1,628,494</u>	<u>4.6</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Suzano Austria GmbH.....	3.75%	01/15/2031	12	10,112	0.0
INVESTITIONSGÜTER					
Parker-Hannifin Corp.....	4.50%	09/15/2029	36	35,425	0.1
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Charter Communications Operating LLC/ Charter Communications Operating Capital.....	5.38%	05/01/2047	20	17,046	0.1
Cox Communications, Inc.....	1.80%	10/01/2030	37	29,262	0.1
Discovery Communications LLC.....	4.65%	05/15/2050	9	6,832	0.0
Discovery Communications LLC.....	5.20%	09/20/2047	16	13,047	0.0
Discovery Communications LLC.....	5.30%	05/15/2049	9	7,417	0.0
Magallanes, Inc.....	3.76%	03/15/2027	11	10,275	0.0
Magallanes, Inc.....	4.05%	03/15/2029	7	6,358	0.0
Omnicom Group, Inc.....	2.45%	04/30/2030	33	27,687	0.1
Thomson Reuters Corp.....	5.50%	08/15/2035	26	26,165	0.1
ViacomCBS, Inc.....	5.50%	05/15/2033	25	24,097	0.1
				<u>168,186</u>	<u>0.5</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
British Telecommunications PLC.....	9.63%	12/15/2030	19	23,480	0.1
Corning, Inc.....	5.45%	11/15/2079	20	18,364	0.0
Vodafone Group PLC.....	4.20%	12/13/2027	AUD 30	19,620	0.1
				<u>61,464</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Harley-Davidson Financial Services, Inc.....	3.05%	02/14/2027	USD 31	27,670	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.....	3.35%	06/08/2025	11	10,547	0.0
Hyundai Capital America.....	1.80%	01/10/2028	20	16,663	0.1
Hyundai Capital America.....	2.10%	09/15/2028	14	11,612	0.0
Volkswagen Bank GmbH.....	1.25%	12/15/2025	EUR 17	16,109	0.0
Volkswagen Financial Services AG.....	0.88%	01/31/2028	35	30,423	0.1
				<u>113,024</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
MDC Holdings, Inc.....	6.00%	01/15/2043	USD 26	21,320	0.1
PulteGroup, Inc.....	6.38%	05/15/2033	11	11,159	0.0
				<u>32,479</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
CK Hutchison Finance 16 II Ltd.....	0.88%	10/03/2024	EUR	100 \$	96,620 0.2%
Ross Stores, Inc.....	1.88%	04/15/2031	USD	35	27,822 0.1
					<u>124,442</u> 0.3
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Altria Group, Inc.....	3.13%	06/15/2031	EUR	100	87,422 0.2
BAT Capital Corp.....	4.91%	04/02/2030	USD	40	37,675 0.1
Sutter Health, Series 20A.....	2.29%	08/15/2030		27	22,816 0.1
Sysco Corp.....	5.95%	04/01/2030		27	28,743 0.1
					<u>176,656</u> 0.5
ENERGIE					
Continental Resources, Inc./OK.....	2.88%	04/01/2032		23	17,932 0.1
Continental Resources, Inc./OK.....	5.75%	01/15/2031		15	14,337 0.0
Devon Energy Corp.....	5.60%	07/15/2041		27	26,707 0.1
Enbridge Energy Partners LP.....	7.38%	10/15/2045		22	26,203 0.1
Energy Transfer LP.....	6.25%	04/15/2049		35	34,350 0.1
Exxon Mobil Corp.....	0.84%	06/26/2032	EUR	100	80,178 0.2
ONEOK, Inc.....	6.35%	01/15/2031	USD	20	20,907 0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.....	3.55%	12/15/2029		4	3,507 0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.....	3.80%	09/15/2030		8	7,089 0.0
Suncor Energy, Inc.....	6.50%	06/15/2038		9	9,695 0.0
Suncor Energy, Inc.....	6.85%	06/01/2039		15	16,744 0.1
TransCanada PipeLines Ltd.....	6.20%	10/15/2037		11	11,811 0.0
TransCanada PipeLines Ltd.....	7.63%	01/15/2039		11	13,418 0.0
Valero Energy Corp.....	6.63%	06/15/2037		9	9,758 0.0
Williams Cos., Inc. (The).....	8.75%	03/15/2032		22	27,163 0.1
					<u>319,799</u> 0.9
DIENSTLEISTUNGEN					
Global Payments, Inc.....	2.90%	11/15/2031		34	27,555 0.1
TECHNOLOGIE					
Broadcom, Inc.....	4.00%	04/15/2029		7	6,489 0.0
Broadcom, Inc.....	4.15%	04/15/2032		26	23,282 0.1
Broadcom, Inc.....	5.00%	04/15/2030		3	2,932 0.0
Dell International LLC/EMC Corp.....	8.35%	07/15/2046		6	7,297 0.0
Fidelity National Information Services, Inc.....	0.63%	12/03/2025	EUR	100	93,199 0.3
Fiserv, Inc.....	2.65%	06/01/2030	USD	14	11,969 0.0
Fiserv, Inc.....	3.50%	07/01/2029		19	17,365 0.1
HP, Inc.....	5.50%	01/15/2033		30	28,851 0.1
Intel Corp.....	5.05%	08/05/2062		22	21,328 0.1
Kyndryl Holdings, Inc.....	2.05%	10/15/2026		23	19,062 0.1
Oracle Corp.....	3.60%	04/01/2040		15	10,926 0.0
Oracle Corp.....	3.65%	03/25/2041		16	11,699 0.0
Oracle Corp.....	5.38%	07/15/2040		4	3,605 0.0
Western Digital Corp.....	2.85%	02/01/2029		6	4,892 0.0
Western Digital Corp.....	3.10%	02/01/2032		40	30,153 0.1
Workday, Inc.....	3.70%	04/01/2029		7	6,566 0.0
Workday, Inc.....	3.80%	04/01/2032		13	11,871 0.0
					<u>311,486</u> 0.9
					<u>1,380,628</u> 3.9
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Enel Finance International NV.....	0.88%	01/17/2031	EUR	100	79,312 0.2
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.....	1.90%	06/15/2028	USD	12	10,391 0.1
					<u>89,703</u> 0.3
					<u>3,098,825</u> 8.8
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal National Mortgage Association, Series 2012.....	3.50%	02/01/2042		5	4,836 0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2012.....	3.50%	11/01/2042		53	51,278 0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2012.....	3.50%	01/01/2043		9	8,732 0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2013.....	3.50%	04/01/2043		30	29,593 0.1
Government National Mortgage Association Series 2022.....	2.50%	09/01/2052		104	104,002 0.3
Uniform Mortgage-Backed Security Series 2022, TBA.....	2.50%	09/01/2052		195	174,159 0.5
Uniform Mortgage-Backed Security Series 2022, TBA.....	3.00%	09/01/2052		149	137,631 0.4
Uniform Mortgage-Backed Security Series 2022, TBA.....	3.50%	09/01/2052		147	139,971 0.4
Uniform Mortgage-Backed Security Series 2022, TBA.....	4.50%	09/01/2052		196	194,941 0.6
					<u>845,143</u> 2.4
GEDECKTE ANLEIHEN					
Canadian Imperial Bank of Commerce.....	0.01%	10/07/2026	EUR	100	91,497 0.2
DNB Boligkreditt AS.....	0.63%	06/19/2025		100	96,289 0.3

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
National Australia Bank Ltd.	2.25%	06/06/2025	EUR 100	\$ 100,366	0.3%
National Bank of Canada.	0.01%	09/29/2026	100	91,551	0.2
National Westminster Bank PLC.	0.50%	05/15/2024	100	97,758	0.3
Royal Bank of Canada.	0.63%	03/23/2026	100	94,710	0.3
Stadshypotek AB.	0.50%	07/11/2025	100	95,823	0.3
Westpac Banking Corp.	0.50%	01/16/2025	100	96,455	0.3
				<u>764,449</u>	<u>2.2</u>
INFLATIONSgebundene Wertpapiere					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Inflation Index.	0.13%	07/15/2024	USD 342	336,622	0.9
U.S. Treasury Inflation Index.	0.13%	10/15/2026	417	407,991	1.2
				<u>744,613</u>	<u>2.1</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB SICAV I - Low Volatility Equity Portfolio - Class S1.			18,599	<u>705,477</u>	<u>2.0</u>
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN					
KANADA					
Canada Housing Trust No.1.	1.55%	12/15/2026	CAD 150	104,892	0.3
Export Development Canada.	0.50%	02/25/2027	EUR 100	93,610	0.3
				<u>198,502</u>	<u>0.6</u>
JAPAN					
Development Bank of Japan, Inc.	0.01%	10/15/2024	100	95,804	0.3
Development Bank of Japan, Inc.	2.30%	03/19/2026	JPY 30,000	232,003	0.6
				<u>327,807</u>	<u>0.9</u>
				<u>526,309</u>	<u>1.5</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2021-R01, Class 1M1(b).	2.93%	10/25/2041	USD 4	3,951	0.0
Series 2021-R01, Class 1M2(b).	3.73%	10/25/2041	10	9,936	0.0
Series 2021-R03, Class 1M1(b).	3.03%	12/25/2041	22	21,884	0.1
Series 2022-R01, Class 1M2(b).	4.08%	12/25/2041	100	95,612	0.3
Series 2022-R02, Class 2M1(b).	3.38%	01/25/2042	77	76,865	0.2
Eagle RE Ltd. Series 2018-1, Class M1 (b).	4.14%	11/25/2028	52	51,321	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency					
Credit Risk Debt Notes					
Series 2021-DNA3, Class M2(b).	4.28%	10/25/2033	17	16,561	0.1
Series 2021-DNA5, Class M2(b).	3.83%	01/25/2034	12	11,711	0.0
Series 2021-HQA4, Class M1(b).	3.13%	12/25/2041	31	30,165	0.1
Series 2022-DNA3, Class M1A(b).	4.18%	04/25/2042	91	91,225	0.3
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue					
Securities					
Series 2014-C03, Class 2M2(b).	5.34%	07/25/2024	4	3,662	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(b).	7.34%	11/25/2024	18	19,193	0.1
Series 2014-C04, Class 2M2(b).	7.44%	11/25/2024	2	2,336	0.0
Series 2015-C04, Class 1M2(b).	8.14%	04/25/2028	7	7,145	0.0
Series 2016-C01, Class 1M2(b).	9.19%	08/25/2028	10	10,776	0.0
Series 2016-C03, Class 1M2(b).	7.74%	10/25/2028	15	15,059	0.0
				<u>467,402</u>	<u>1.3</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
FRANKREICH					
Dexia Credit Local SA.	0.50%	01/17/2025	EUR 100	<u>96,802</u>	<u>0.3</u>
DEUTSCHLAND					
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau.	3.20%	09/11/2026	AUD 24	<u>15,961</u>	<u>0.0</u>
INDONESIEN					
Indonesia Government International Bond.	1.00%	07/28/2029	EUR 100	<u>83,367</u>	<u>0.2</u>
MEXIKO					
Mexico Government International Bond.	3.38%	02/23/2031	110	<u>102,413</u>	<u>0.3</u>
PERU					
Peruvian Government International Bond.	3.75%	03/01/2030	100	<u>99,917</u>	<u>0.3</u>
				<u>398,460</u>	<u>1.1</u>
SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN					
European Investment Bank.	0.75%	07/15/2027	AUD 51	29,749	0.1
European Investment Bank.	1.80%	01/19/2027	45	28,107	0.1
Inter-American Development Bank.	2.50%	04/14/2027	40	25,565	0.0
International Bank for Reconstruction & Development.	0.00%	01/15/2027	34	31,197	0.1
International Bank for Reconstruction & Development, Series GDIF.	0.00%	02/21/2030	32	27,207	0.1
International Bank For Reconstruction, Series GDIF.	0.01%	04/24/2028	EUR 46	40,908	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Nordic Investment Bank	4.75%	02/28/2024	AUD	60 \$ 41,748	0.1%
				<u>224,481</u>	<u>0.6</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN					
KANADA					
Province of British Columbia Canada	4.25%	11/27/2024		130	89,309 0.2
Province of Ontario Canada	2.70%	06/02/2029	CAD	95	67,647 0.2
Province of Quebec Canada	3.65%	05/20/2032		24	17,998 0.1
				<u>174,954</u>	<u>0.5</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – REGIONALANLEIHEN					
JAPAN					
Japan Finance Organization for Municipalities, Series G	0.01%	02/02/2028	EUR	100	88,407 0.3
ABS-ANLEIHEN					
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Flagship Credit Auto Trust, Series 2018-3, Class D	4.15%	12/16/2024	USD	39	38,761 0.1
Gesamtanlagen				\$ 34,600,786	97.8%
(Kosten \$36,514,109)					
Termineinlagen					
ANZ, London(c)	0.80 %	–		2,120	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(c)	1.37 %	–		685	0.0
BBH, Grand Cayman(c)	0.80 %	–		1	0.0
BBH, Grand Cayman(c)	1.65 %	–		697	0.0
BBH, Grand Cayman(c)	4.15 %	–		519	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	(0.34)%	–		435	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	(0.12)%	–		1,862	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	0.19 %	–		16,482	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	0.40 %	–		444	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	0.80 %	–		1,523	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(c)	(0.58)%	–		29,271	0.1
DBS Bank Ltd, Singapore(c)	1.68 %	–		1,397,534	4.0
Deutsche Bank, Frankfurt(c)	(0.13)%	–		494	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(c)	0.40 %	–		1,559	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Singapore(c)	1.10 %	–		171	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(c)	(0.13)%	–		7,672	0.0
SEB, Stockholm(c)	0.19 %	–		440	0.0
SEB, Stockholm(c)	1.68 %	–		61,890	0.2
Sumitomo, London(c)	(0.34)%	–		12,921	0.0
Sumitomo, London(c)	0.87 %	–		3,106	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>1,539,826</u>	<u>4.3</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(745,935)</u>	<u>(2.1)</u>
Nettovermögen				<u>\$ 35,394,677</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
10 Yr Australian Bond Futures	09/15/2022	2	\$ 167,326	\$ 164,164	\$ (3,162)
10 Yr Canadian Bond Futures	12/19/2022	2	189,987	189,729	(259)
10 Yr Mini Japan Government Bond Futures	09/09/2022	4	431,607	430,506	(1,101)
Euro STOXX 50 Index Futures	09/16/2022	4	146,973	141,114	(5,859)
Euro-Bund Futures	09/08/2022	2	305,153	297,405	(7,748)
Euro-Schatz Futures	09/08/2022	5	549,733	545,738	(3,995)
Hang Seng Idx Future	09/29/2022	3	374,918	377,538	2,620
Korea 3 Yr Bond Futures	09/20/2022	12	925,977	928,384	2,407
MSCI Emerging Markets Index Futures	09/16/2022	1	49,450	49,095	(355)
TOPIX Index Futures	09/08/2022	2	283,822	280,463	(3,359)
U.S. 2 Yr Note (CBT) Futures	12/30/2022	5	1,043,562	1,041,641	(1,921)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	12/30/2022	1	110,820	110,820	0
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	12/20/2022	9	1,060,805	1,052,156	(8,649)
Short					
Euro-BOBL Futures	09/08/2022	5	627,229	618,446	8,783
Euro-OAT Futures	09/08/2022	1	140,452	138,703	1,749
FTSE 100 IDX Futures	09/16/2022	8	694,547	675,129	19,418
Long Gilt Futures	12/28/2022	1	127,833	125,382	2,451
MSCI Singapore IX ETS Futures	09/29/2022	3	63,443	61,857	1,586
OMXS30 Index Futures	09/16/2022	1	19,248	17,935	1,313
S&P 500 E-Mini Futures	09/16/2022	6	1,191,314	1,186,950	4,364
S&P/TSX 60 IX Futures	09/15/2022	2	348,805	354,818	(6,013)

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
SPI 200 Futures	09/15/2022	1	\$ 118,029	\$ 116,938	\$ 1,091
					\$ 3,361
				Wertsteigerung	\$ 45,782
				Wertminderung	\$ (42,421)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Bank of America, NA	JPY 242,450	USD 1,769	09/08/2022	\$ 22,630
Bank of America, NA	EUR 4,816	USD 4,902	09/29/2022	53,711
Bank of America, NA	USD 5	TWD 139	10/21/2022	7
Barclays Bank PLC	IDR 662,329	USD 44	10/27/2022	(887)
Barclays Bank PLC	MYR 278	USD 63	12/15/2022	693
BNP Paribas SA	USD 12	CNH 78	10/20/2022	(266)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF 533	USD 547	09/08/2022	1,820
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 233	CHF 226	09/08/2022	(2,405)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 569	JPY 77,737	09/08/2022	(9,327)
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY 76,116	USD 564	09/08/2022	15,832
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 17	SGD 24	09/15/2022	95
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 305	NOK 3,062	09/22/2022	3,232
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 305	SEK 3,117	09/22/2022	(12,674)
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK 412	USD 41	09/22/2022	(657)
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK 2,547	USD 263	09/22/2022	6,131
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK 4,590	USD 438	09/22/2022	6,976
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 21	MXN 425	09/29/2022	428
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 1,306	USD 1,332	09/29/2022	17,567
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 390	EUR 390	09/29/2022	(14,270)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 759	EUR 740	09/29/2022	2,490
Brown Brothers Harriman & Co.	ILS 126	USD 37	10/19/2022	(1,178)
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD 629	USD 434	10/20/2022	3,830
Brown Brothers Harriman & Co.	CNH 75	USD 11	10/20/2022	97
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 1,049	AUD 1,518	10/20/2022	(9,899)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD 1,031	USD 801	10/27/2022	16,103
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 647	CAD 840	10/27/2022	(7,829)
Brown Brothers Harriman & Co.	THB 1,102	USD 31	11/10/2022	813
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 668	USD 787	11/17/2022	9,795
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 12	GBP 10	11/17/2022	(15)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 134	NZD 216	11/18/2022	(1,355)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 0*	EUR 0*	09/06/2022	4
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 0*	USD 0*	09/06/2022	(4)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 0*	USD 0*	09/06/2022	3
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 123	USD 123	09/12/2022	(600)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,671	EUR 2,683	09/12/2022	26,652
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,683	USD 2,782	09/12/2022	83,896
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,831	EUR 2,732	09/12/2022	(83,541)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 0*	EUR 0*	09/19/2022	4
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 0*	USD 0*	09/19/2022	(4)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 0*	USD 0*	09/19/2022	3
Citibank, NA	AUD 1,742	USD 1,203	10/20/2022	9,897
Citibank, NA	KRW 144,858	USD 110	10/27/2022	2,397
Deutsche Bank AG	BRL 271	USD 50	09/02/2022	(1,997)
Goldman Sachs Bank USA	CNH 2,462	USD 365	10/20/2022	8,059
HSBC Bank USA	IDR 339,207	USD 23	10/27/2022	(91)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 73	BRL 368	09/02/2022	(2,468)
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL 368	USD 73	10/04/2022	2,458
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 7	CNH 51	10/20/2022	6
Royal Bank of Scotland PLC	BRL 97	USD 19	09/02/2022	145
Royal Bank of Scotland PLC	CNH 90	USD 13	10/20/2022	87
Royal Bank of Scotland PLC	USD 12	CNH 79	10/20/2022	(254)
Standard Chartered Bank	TWD 3,483	USD 117	10/21/2022	2,305
				\$ 148,445
			Wertsteigerung	\$ 298,166
			Wertminderung	\$ (149,721)

+ 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)	EUR 176	05/12/2027	6 Month EURIBOR	1.494%	\$ (5,649)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	EUR 134	05/13/2027	6 Month EURIBOR	1.464%	(4,481)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	EUR 100	09/30/2050	6 Month EURIBOR	(0.017)%	(27,826)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	EUR 100	11/10/2050	6 Month EURIBOR	(0.043)%	(27,526)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	NZD 270	11/02/2024	3 Month BKBM	2.503%	(6,582)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	NZD 100	11/01/2024	3 Month BKBM	2.580%	(2,474)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	EUR 100	11/10/2050	0.022%	6 Month EURIBOR	28,164
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	EUR 100	09/30/2050	0.122%	6 Month EURIBOR	29,178
					<u>\$ (17,196)</u>
				Wertsteigerung	\$ 57,342
				Wertminderung	\$ (74,538)

TOTAL-RETURN-SWAPS

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahler/ Erhaltener Zinssatz	Nominal- betrag (000)	Fälligkeits- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation erhalten					
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Bloomberg Commodity Index	3,864	0 14%	USD 1,357	09/15/2022	\$ (79,304)
JPMorgan Chase Bank, NA					
FTSE EPRA/NAREIT Developed Real Estate Index	52	OBFR Plus 0.53%	USD 312	05/15/2023	(26,305)
UBS AG					
FTSE EPRA/NAREIT Developed Real Estate Index	181	OBFR Plus 0.43%	USD 972	09/15/2022	22,133
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Swiss Market Index Futures	10	0.00%	CHF 111	09/16/2022	(2,643)
Insgesamt					<u>\$ (86,119)</u>
				Wertsteigerung	\$ 22,133
				Wertminderung	\$ (108,252)
Swaps insgesamt					<u>\$ (103,315)</u>

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger 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 31. August 2022.
- (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
- IDR – Indonesian Rupiah
- ILS – Israeli Shekel
- JPY – Japanese Yen
- KRW – South Korean Won
- MXN – Mexican Peso
- MYR – Malaysian Ringgit
- NOK – Norwegian Krone
- NZD – New Zealand Dollar
- SEK – Swedish Krona
- SGD – Singapore Dollar
- THB – Thailand Baht
- TWD – New Taiwan Dollar
- USD – United States Dollar

Glossar:

ADR	– American Depositary Receipt
BKBM	– Bank Bill Benchmark (New Zealand)
BOBL	– Bundesobligationen
CBT	– Chicago Board of Trade
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
OAT	– Obligations Assimilables du Trésor
OBFR	– Overnight Bank Funding Rate
REG	– Registered Shares
SPI	– Share Price Index
TOPIX	– Tokyo Price Index
TSX	– Toronto Stock Exchange

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG			
Calix, Inc.	11,688	\$ 687,816	0.7%
Lumentum Holdings, Inc.	14,864	1,241,850	1.4
		<u>1,929,666</u>	<u>2.1</u>
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Flex Ltd.	71,238	1,268,749	1.4
Keyence Corp.	1,188	445,897	0.5
		<u>1,714,646</u>	<u>1.9</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Accenture PLC - Class A	2,392	689,978	0.8
BIPROGY, Inc.	22,144	490,417	0.5
Visa, Inc. - Class A	8,806	1,749,838	1.9
		<u>2,930,233</u>	<u>3.2</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
ASML Holding NV	1,897	926,110	1.0
Infineon Technologies AG	24,981	611,248	0.7
MediaTek, Inc.	22,720	491,580	0.5
Novatek Microelectronics Corp.	34,730	297,122	0.3
NXP Semiconductors NV	7,730	1,272,181	1.4
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	100,590	1,646,638	1.8
		<u>5,244,879</u>	<u>5.7</u>
SOFTWARE			
ACI Worldwide, Inc.	15,555	368,658	0.4
Adobe, Inc.	2,026	756,651	0.8
CommVault Systems, Inc.	13,046	708,244	0.7
Dassault Systemes SE	21,727	837,846	0.9
Intuit, Inc.	1,474	636,519	0.7
Microsoft Corp.	4,520	1,181,832	1.3
NortonLifeLock, Inc.	24,024	542,706	0.6
Oracle Corp.	18,573	1,377,154	1.5
		<u>6,409,610</u>	<u>6.9</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	7,195	1,131,123	1.2
Dell Technologies, Inc. - Class C	13,586	520,190	0.6
Samsung Electronics Co., Ltd.	12,298	544,822	0.6
Western Digital Corp.	17,266	729,681	0.8
		<u>2,925,816</u>	<u>3.2</u>
		<u>21,154,850</u>	<u>23.0</u>
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Abcam PLC	36,990	545,812	0.6
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Alcon, Inc.	9,565	629,804	0.7
Becton Dickinson and Co.	4,120	1,040,062	1.1
Koninklijke Philips NV	23,447	389,409	0.4
Medtronic PLC	8,346	733,799	0.8
STERIS PLC	4,922	991,149	1.1
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	6,354	675,573	0.7
		<u>4,459,796</u>	<u>4.8</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Apollo Hospitals Enterprise Ltd.	13,729	735,461	0.8
Centene Corp.	8,451	758,379	0.8
		<u>1,493,840</u>	<u>1.6</u>
GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE			
Change Healthcare, Inc.	37,531	922,141	1.0
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A	1,625	788,313	0.8
Bruker Corp.	9,822	550,020	0.6
Danaher Corp.	4,646	1,254,069	1.4
Gerresheimer AG	7,385	386,324	0.4
ICON PLC	2,125	445,959	0.5
West Pharmaceutical Services, Inc.	2,681	795,420	0.9
		<u>4,220,105</u>	<u>4.6</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
PHARMAZEUTIKA			
Roche Holding AG (Genusschein)	4,424	\$ 1,425,692	1.6%
Sanofi	7,064	577,502	0.6
		<u>2,003,194</u>	<u>2.2</u>
		<u>13,644,888</u>	<u>14.8</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Leumi Le-Israel BM	50,024	528,816	0.6
Bank of Ireland Group PLC	120,678	743,566	0.8
Erste Group Bank AG	32,030	720,278	0.8
HDFC Bank Ltd.	49,981	914,731	1.0
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A	154,039	379,970	0.4
KB Financial Group, Inc.	15,454	567,288	0.6
Natwest Group PLC	238,195	679,728	0.7
SVB Financial Group	1,940	788,801	0.9
Wells Fargo & Co.	24,650	1,077,449	1.2
		<u>6,400,627</u>	<u>7.0</u>
KAPITALMÄRKTE			
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	135,807	309,341	0.3
Deutsche Boerse AG	4,641	784,657	0.8
London Stock Exchange Group PLC	5,573	522,741	0.6
MSCI, Inc.	2,425	1,089,182	1.2
Partners Group Holding AG	1,058	1,020,754	1.1
		<u>3,726,675</u>	<u>4.0</u>
VERSICHERUNGEN			
Aflac, Inc.	14,319	850,813	0.9
AIA Group Ltd.	75,981	731,035	0.8
Intact Financial Corp.	0*	9	0.0
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	105,482	620,408	0.7
Suncorp Group Ltd.	106,459	786,223	0.8
Willis Towers Watson PLC	2,222	459,478	0.5
		<u>3,447,966</u>	<u>3.7</u>
		<u>13,575,268</u>	<u>14.7</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Airbus SE	6,901	676,228	0.7
Hexcel Corp.	11,972	702,376	0.8
Spirit AeroSystems Holdings, Inc. - Class A	14,478	435,780	0.5
		<u>1,814,384</u>	<u>2.0</u>
BAUPRODUKTE			
Owens Corning	7,666	626,546	0.7
Trex Co., Inc.	9,580	448,245	0.5
		<u>1,074,791</u>	<u>1.2</u>
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
MillerKnoll, Inc.	12,604	348,883	0.4
Tetra Tech, Inc.	6,661	904,672	1.0
TOMRA Systems ASA	40,920	932,436	1.0
Waste Management, Inc.	8,444	1,427,267	1.5
		<u>3,613,258</u>	<u>3.9</u>
BAU- UND INGENIEURWESEN			
AECOM	9,784	715,730	0.8
Dycom Industries, Inc.	2,253	252,558	0.3
		<u>968,288</u>	<u>1.1</u>
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Regal Rexnord Corp.	7,084	974,659	1.1
Vertiv Holdings Co.	52,229	602,198	0.6
		<u>1,576,857</u>	<u>1.7</u>
MASCHINEN			
Alstom SA (a)	14,979	306,966	0.3
Amada Co., Ltd.	86,617	677,730	0.7
Deere & Co.	3,495	1,276,514	1.4
SMC Corp.	1,799	853,716	0.9
Xylem, Inc./NY	6,651	605,868	0.7
		<u>3,720,794</u>	<u>4.0</u>
STRASSE UND SCHIENE			
XPO Logistics, Inc.	12,952	678,949	0.7
		<u>13,447,321</u>	<u>14.6</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Aptiv PLC	4,994	\$ 466,589	0.5%
Faurecia SE	30,045	430,871	0.5
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	36,148	<u>507,154</u>	<u>0.5</u>
		<u>1,404,614</u>	<u>1.5</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Stellantis NV	49,230	<u>655,229</u>	<u>0.7</u>
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
ADT, Inc.	92,230	<u>672,355</u>	<u>0.7</u>
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Entain PLC	45,724	672,720	0.7
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	298,040	<u>610,434</u>	<u>0.7</u>
		<u>1,283,154</u>	<u>1.4</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Midea Group Co., Ltd. - Class A	55,192	422,622	0.5
PulteGroup, Inc.	18,009	732,242	0.8
TopBuild Corp.	2,475	<u>454,737</u>	<u>0.5</u>
		<u>1,609,601</u>	<u>1.8</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
eBay, Inc.	10,936	<u>482,588</u>	<u>0.5</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	76,573	<u>362,066</u>	<u>0.4</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Carter's, Inc.	9,611	709,779	0.8
NIKE, Inc. - Class B	7,634	812,651	0.9
Tapestry, Inc.	20,336	<u>706,264</u>	<u>0.7</u>
		<u>2,228,694</u>	<u>2.4</u>
		<u>8,698,301</u>	<u>9.4</u>
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
EDP - Energias de Portugal SA	196,507	938,438	1.0
Enel SpA	144,471	678,879	0.7
NextEra Energy, Inc.	13,613	1,157,906	1.3
Orsted AS	7,612	<u>742,999</u>	<u>0.8</u>
		<u>3,518,222</u>	<u>3.8</u>
GASVERSORGUNGSBETRIEBE			
China Resources Gas Group Ltd.	94,404	367,552	0.4
Kunlun Energy Co., Ltd.	870,502	<u>757,969</u>	<u>0.8</u>
		<u>1,125,521</u>	<u>1.2</u>
WASSERVERSORGER			
American Water Works Co., Inc.	4,029	<u>598,034</u>	<u>0.7</u>
		<u>5,241,777</u>	<u>5.7</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Charter Communications, Inc. - Class A	2,779	1,146,702	1.2
Comcast Corp. - Class A	25,717	930,698	1.0
Deutsche Telekom AG (REG)	33,960	<u>640,051</u>	<u>0.7</u>
		<u>2,717,451</u>	<u>2.9</u>
UNTERHALTUNG			
Electronic Arts, Inc.	6,321	<u>801,966</u>	<u>0.9</u>
		<u>3,519,417</u>	<u>3.8</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Chr Hansen Holding A/S	9,929	578,550	0.6
Koninklijke DSM NV	5,330	<u>679,689</u>	<u>0.8</u>
		<u>1,258,239</u>	<u>1.4</u>
METALL UND BERGBAU			
ArcelorMittal SA	30,954	734,663	0.8
ATI, Inc.	17,946	537,110	0.6
Endeavour Mining PLC	22,227	<u>432,781</u>	<u>0.4</u>
		<u>1,704,554</u>	<u>1.8</u>
		<u>2,962,793</u>	<u>3.2</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Coca-Cola Co. (The)	13,259	<u>818,232</u>	<u>0.9</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL					
Atacadao SA			123,416	\$ 468,527	0.5%
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Hain Celestial Group, Inc. (The)			20,686	419,106	0.4
Nomad Foods Ltd.			24,338	430,536	0.5
Salmar ASA			6,520	431,131	0.5
				<u>1,280,773</u>	<u>1.4</u>
				<u>2,567,532</u>	<u>2.8</u>
ENERGIE					
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE					
Baker Hughes Co.			14,161	357,703	0.4
Shell PLC			56,565	1,497,677	1.6
				<u>1,855,380</u>	<u>2.0</u>
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Cameco Corp.			21,264	619,843	0.7
				<u>2,475,223</u>	<u>2.7</u>
IMMOBILIEN					
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)					
Americold Realty Trust, Inc.			24,753	728,234	0.8
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG					
CIFI Holdings Group Co., Ltd. (a)			1,151,972	291,558	0.3
				<u>1,019,792</u>	<u>1.1</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$99,202,882)				\$ 88,307,162	95.8%
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	0.80 %	–		4,568	0.0
ANZ, London(b)	1.68 %	–		3,067,572	3.4
Barclays, London(b)	1.68 %	–		3,014	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.34)%	–		9,601	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.12)%	–		5,089	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.19 %	–		4,668	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.40 %	–		9,508	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.80 %	–		8,215	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(0.58)%	–		9,676	0.0
JPMorgan Chase, New York(b)	1.68 %	–		527,779	0.6
SEB, Stockholm(b)	0.19 %	–		4,483	0.0
Sumitomo, London(b)	0.87 %	–		16,772	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.13)%	–		15,609	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>3,686,554</u>	<u>4.0%</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>157,431</u>	<u>0.2</u>
Nettovermögen				<u>\$ 92,151,147</u>	<u>100.0%</u>

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausbungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	USD 1,090	JPY 149,370	09/08/2022	\$ (13,942)
Bank of America, NA	NOK 6,354	USD 630	09/22/2022	(9,920)
Bank of America, NA	EUR 8,062	USD 8,213	09/29/2022	96,839
Bank of America, NA	EUR 156	USD 157	09/29/2022	(352)
Bank of America, NA	USD 79	EUR 79	09/29/2022	71
Bank of America, NA	USD 186	ZAR 3,081	10/13/2022	(7,190)
Bank of America, NA	USD 109	CAD 140	10/27/2022	(2,553)
Barclays Bank PLC	NOK 1,445	USD 149	09/22/2022	3,384
Barclays Bank PLC	INR 53,635	USD 673	09/28/2022	8
BNP Paribas SA	USD 290	CNH 1,975	10/20/2022	(4,142)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 4,266	USD 4,423	09/12/2022	132,903
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 285	USD 285	09/12/2022	(1,458)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,276	EUR 4,294	09/12/2022	41,904
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,486	EUR 4,329	09/12/2022	(132,451)
Citibank, NA	EUR 155	USD 155	09/29/2022	(307)
Citibank, NA	USD 922	EUR 923	09/29/2022	7,343
Citibank, NA	ILS 1,372	USD 401	10/19/2022	(12,264)
Citibank, NA	USD 1,680	CNH 11,326	10/20/2022	(38,968)
Citibank, NA	KRW 1,286,869	USD 981	10/27/2022	21,297
Citibank, NA	USD 1,386	CAD 1,788	10/27/2022	(25,514)
Citibank, NA	USD 538	KRW 706,072	10/27/2022	(11,582)
Deutsche Bank AG	BRL 3,150	USD 582	09/02/2022	(23,210)

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Deutsche Bank AG	USD 238	BRL 1,289	09/02/2022	\$ 9,499
Goldman Sachs Bank USA	USD 147	EUR 147	09/29/2022	521
Goldman Sachs Bank USA	CNH 26,969	USD 3,995	10/20/2022	88,284
Goldman Sachs Bank USA	USD 65	TWD 1,943	10/21/2022	(1,183)
JPMorgan Chase Bank	TWD 3,316	USD 111	10/21/2022	1,372
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL 1,289	USD 256	09/02/2022	8,645
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 792	BRL 3,981	09/02/2022	(26,698)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 142	JPY 19,139	09/08/2022	(3,780)
Morgan Stanley Capital Services LLC	SEK 750	USD 74	09/22/2022	3,877
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 101	NOK 1,001	09/22/2022	(742)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 48	EUR 47	09/29/2022	(34)
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL 3,981	USD 786	10/04/2022	26,593
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 254	BRL 1,289	10/04/2022	(8,611)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CNH 1,267	USD 185	10/20/2022	1,279
Royal Bank of Scotland PLC	CHF 293	USD 309	09/08/2022	9,053
Royal Bank of Scotland PLC	NOK 1,488	USD 157	09/22/2022	7,230
Royal Bank of Scotland PLC	EUR 339	USD 350	09/29/2022	8,679
Royal Bank of Scotland PLC	CNH 1,003	USD 146	10/20/2022	972
Royal Bank of Scotland PLC	USD 124	CNH 839	10/20/2022	(2,699)
Royal Bank of Scotland PLC	USD 611	GBP 514	11/17/2022	(12,858)
Standard Chartered Bank	INR 11,422	USD 142	09/28/2022	(1,100)
Standard Chartered Bank	TWD 43,785	USD 1,475	10/21/2022	29,988
State Street Bank & Trust Co.	HKD 2,614	USD 333	09/21/2022	287
State Street Bank & Trust Co.	USD 222	EUR 217	09/29/2022	(3,319)
UBS AG	BRL 831	USD 161	09/02/2022	1,247
UBS AG	USD 403	SEK 4,104	09/22/2022	(17,397)
UBS AG	USD 827	AUD 1,197	10/20/2022	(7,285)
				\$ 131,716
			Wertsteigerung	\$ 501,275
			Wertminderung	\$ (369,559)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

* Anteilsbetrag weniger als 0.50.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

REG	– Registered Shares
REIT	– Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
BIPROGY, Inc.	320,256	\$ 7,092,585	1.1%
Visa, Inc. - Class A	54,530	10,835,567	1.6
		<u>17,928,152</u>	<u>2.7</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Novatek Microelectronics Corp.	502,270	4,297,076	0.6
NXP Semiconductors NV	39,527	6,505,339	1.0
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	837,117	13,703,442	2.1
		<u>24,505,857</u>	<u>3.7</u>
SOFTWARE			
ACI Worldwide, Inc.	224,965	5,331,666	0.8
CommVault Systems, Inc.	188,669	10,242,864	1.5
NortonLifeLock, Inc.	347,446	7,848,801	1.2
Oracle Corp.	268,602	19,916,873	3.0
		<u>43,340,204</u>	<u>6.5</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Samsung Electronics Co., Ltd.	177,862	7,879,413	1.2
Western Digital Corp.	249,714	10,552,894	1.6
		<u>18,432,307</u>	<u>2.8</u>
		<u>104,206,520</u>	<u>15.7</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Faurecia SE	434,521	6,231,399	0.9
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	522,782	7,334,634	1.1
		<u>13,566,033</u>	<u>2.0</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Stellantis NV	711,982	9,476,145	1.4
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
ADT, Inc.	1,333,860	9,723,840	1.5
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Entain PLC	661,276	9,729,110	1.5
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	4,310,360	8,828,308	1.3
		<u>18,557,418</u>	<u>2.8</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Midea Group Co., Ltd. - Class A	798,208	6,112,107	0.9
PulteGroup, Inc.	260,451	10,589,942	1.6
		<u>16,702,049</u>	<u>2.5</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
eBay, Inc.	158,154	6,979,354	1.1
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	1,107,427	5,236,324	0.8
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Carter's, Inc.	138,999	10,265,070	1.6
Tapestry, Inc.	294,104	10,214,237	1.5
		<u>20,479,307</u>	<u>3.1</u>
		<u>100,720,470</u>	<u>15.2</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Leumi Le-Israel BM	723,466	7,647,921	1.2
Bank of Ireland Group PLC	1,745,294	10,753,711	1.6
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A	2,227,761	5,495,253	0.8
KB Financial Group, Inc.	223,496	8,204,320	1.2
Natwest Group PLC	3,444,853	9,830,465	1.5
Wells Fargo & Co.	356,496	15,582,443	2.3
		<u>57,514,113</u>	<u>8.6</u>
KAPITALMÄRKTE			
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	1,964,093	4,473,800	0.7
VERSICHERUNGEN			
Intact Financial Corp.	1	135	0.0
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	1,525,518	8,972,556	1.4
Suncorp Group Ltd.	1,539,641	11,370,636	1.7
Willis Towers Watson PLC	32,128	6,645,132	1.0
		<u>26,988,459</u>	<u>4.1</u>
		<u>88,976,372</u>	<u>13.4</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Airbus SE	99,801	\$ 9,779,837	1.5%
Spirit AeroSystems Holdings, Inc. - Class A	209,382	6,302,406	0.9
		<u>16,082,243</u>	<u>2.4</u>
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
MillerKnoll, Inc.	182,286	5,045,672	0.8
BAU- UND INGENIEURWESEN			
AECOM	141,506	10,351,134	1.6
Dycom Industries, Inc.	32,577	3,652,581	0.5
		<u>14,003,715</u>	<u>2.1</u>
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Regal Rexnord Corp.	102,448	14,095,850	2.1
Vertiv Holdings Co.	755,351	8,709,199	1.3
		<u>22,805,049</u>	<u>3.4</u>
MASCHINEN			
Alstom SA (a)	216,630	4,439,454	0.6
Amada Co., Ltd.	1,252,683	9,801,568	1.5
		<u>14,241,022</u>	<u>2.1</u>
STRASSE UND SCHIENE			
XPO Logistics, Inc.	187,318	9,819,204	1.5
		<u>81,996,905</u>	<u>12.3</u>
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Medtronic PLC	120,706	10,612,453	1.6
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	91,896	9,770,367	1.5
		<u>20,382,820</u>	<u>3.1</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Centene Corp.	122,219	10,967,946	1.6
GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE			
Change Healthcare, Inc.	542,789	13,336,322	2.0
PHARMAZEUTIKA			
Roche Holding AG (Genusschein)	63,986	20,618,859	3.1
Sanofi	102,166	8,352,033	1.3
		<u>28,970,892</u>	<u>4.4</u>
		<u>73,657,980</u>	<u>11.1</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Charter Communications, Inc. - Class A	40,191	16,584,009	2.5
Comcast Corp. - Class A	371,928	13,460,075	2.0
Deutsche Telekom AG (REG)	491,140	9,256,632	1.4
		<u>39,300,716</u>	<u>5.9</u>
UNTERHALTUNG			
Electronic Arts, Inc.	91,419	11,598,308	1.8
		<u>50,899,024</u>	<u>7.7</u>
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
EDP - Energias de Portugal SA	2,841,953	13,572,015	2.0
Enel SpA	2,089,389	9,818,187	1.5
		<u>23,390,202</u>	<u>3.5</u>
GASVERSORGUNGSBETRIEBE			
China Resources Gas Group Ltd.	1,365,296	5,315,658	0.8
Kunlun Energy Co., Ltd.	12,589,498	10,962,016	1.7
		<u>16,277,674</u>	<u>2.5</u>
		<u>39,667,876</u>	<u>6.0</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Coca-Cola Co. (The)	191,761	11,833,552	1.8
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Atacadao SA	1,784,884	6,776,000	1.0
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Hain Celestial Group, Inc. (The)	299,174	6,061,257	0.9
Nomad Foods Ltd.	351,982	6,226,565	0.9
Salmar ASA	94,290	6,235,171	1.0
		<u>18,522,993</u>	<u>2.8</u>
		<u>37,132,545</u>	<u>5.6</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ENERGIE					
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE					
Baker Hughes Co.			204,799	\$ 5,173,227	0.8%
Shell PLC			818,063	21,659,927	3.2
				<u>26,833,154</u>	<u>4.0</u>
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Cameco Corp.			307,526	8,964,385	1.4
				<u>35,797,539</u>	<u>5.4</u>
GRUNDSTOFFE					
METALL UND BERGBAU					
ArcelorMittal SA			447,666	10,624,955	1.6
ATI, Inc.			259,534	7,767,867	1.2
Endeavour Mining PLC			321,448	6,259,025	0.9
				<u>24,651,847</u>	<u>3.7</u>
IMMOBILIEN					
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)					
Americold Realty Trust, Inc.			357,987	10,531,976	1.6
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG					
CIFI Holdings Group Co., Ltd. (a)			16,660,212	4,216,611	0.6
				<u>14,748,587</u>	<u>2.2</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$758,711,217)				\$ 652,455,665	98.3%
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	0.80 %	–		66,411	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	1.37 %	–		1	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	4.15 %	–		3,048	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.34)%	–		68,170	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.12)%	–		1,697	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.40 %	–		67,883	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.80 %	–		47,189	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(0.58)%	–		68,572	0.0
JPMorgan Chase, New York(b)	1.68 %	–		7,633,911	1.2
SEB, Stockholm(b)	0.19 %	–		64,840	0.0
Sumitomo, London(b)	0.87 %	–		65,611	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.13)%	–		70,452	0.0
				<u>8,157,785</u>	<u>1.2</u>
Termineinlagen insgesamt				3,174,120	0.5
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					
Nettovermögen				\$ 663,787,570	100.0%

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA.	EUR 59,702	USD 60,776	09/29/2022	\$ 668,673
Bank of America, NA.	EUR 2,261	USD 2,271	09/29/2022	(5,093)
Bank of America, NA.	USD 1,147	EUR 1,140	09/29/2022	1,032
BNP Paribas SA	USD 4,197	CNH 28,557	10/20/2022	(59,908)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 31,655	USD 22,411	09/12/2022	747,899
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 5,300	USD 4,137	09/12/2022	101,464
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 914	USD 946	09/12/2022	27,645
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 63	USD 64	09/12/2022	(353)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 18,323	USD 22,395	09/12/2022	1,104,524
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 8,271	USD 6,038	09/12/2022	118,742
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 41,686	AUD 59,672	09/12/2022	(849,622)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 7,456	CAD 9,613	09/12/2022	(136,348)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 929	EUR 924	09/12/2022	187
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 946	EUR 914	09/12/2022	(27,645)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 42,083	GBP 34,954	09/12/2022	(1,469,587)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4	SGD 6	09/12/2022	1
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 11,388	SGD 15,714	09/12/2022	(142,990)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 9,143	ZAR 151,963	09/12/2022	(278,325)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 79,662	USD 4,905	09/12/2022	258,361
Citibank, NA	EUR 2,234	USD 2,245	09/29/2022	(4,436)
Citibank, NA	USD 2,059	EUR 2,062	09/29/2022	17,145
Citibank, NA	ILS 19,841	USD 5,793	10/19/2022	(177,372)
Citibank, NA	KRW 18,611,139	USD 14,186	10/27/2022	307,997

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Deutsche Bank AG	BRL	45,549	USD	8,420	09/02/2022	\$ (335,666)
Goldman Sachs Capital Markets	USD	2,127	EUR	2,120	09/29/2022	7,540
Goldman Sachs Capital Markets	CNH	390,029	USD	57,775	10/20/2022	1,276,798
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	11,452	BRL	57,570	09/02/2022	(386,114)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	691	EUR	685	09/29/2022	(497)
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL	57,570	USD	11,361	10/04/2022	384,594
Morgan Stanley Capital Services LLC	CNH	18,327	USD	2,673	10/20/2022	18,502
Royal Bank of Scotland PLC	EUR	2,076	USD	2,152	09/29/2022	61,635
Royal Bank of Scotland PLC	CNH	14,503	USD	2,115	10/20/2022	14,053
Royal Bank of Scotland PLC	USD	1,797	CNH	12,133	10/20/2022	(39,027)
Standard Chartered Bank	TWD	476,395	USD	16,046	10/21/2022	326,278
UBS	BRL	12,021	USD	2,329	09/02/2022	18,036
						\$ 1,548,123
						Wertsteigerung \$ 5,461,106
						Wertminderung \$ (3,912,983)

+ 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
BRL	– Brazilian Real
CAD	– Canadian Dollar
CNH	– Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
EUR	– Euro
GBP	– Great British Pound
ILS	– Israeli Shekel
KRW	– South Korean Won
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 Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KRAFTFAHRZEUGE			
NIO, Inc. - Class A (a)	493,900	\$ 9,819,063	1.8%
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Despegar.com Corp.	1,150,020	9,096,658	1.7
Galaxy Entertainment Group Ltd.	1,014,000	5,667,940	1.0
MakeMyTrip Ltd.	335,440	11,186,924	2.1
OPAP SA	759,009	9,997,602	1.8
		<u>35,949,124</u>	<u>6.6</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	1,062,200	12,672,628	2.3
JD.com, Inc. - Class A	687,103	21,750,349	4.0
Meituan - Class B	731,800	17,575,803	3.2
MercadoLibre, Inc.	7,690	6,577,718	1.2
		<u>58,576,498</u>	<u>10.7</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
China Tourism Group Duty Free Corp., Ltd. - Class A	296,900	8,372,021	1.5
Lojas Renner SA	2,034,800	10,353,136	1.9
		<u>18,725,157</u>	<u>3.4</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
ANTA Sports Products Ltd.	394,800	4,754,354	0.9
Li Ning Co., Ltd.	700,500	6,380,373	1.2
Samsonite International SA	2,763,900	6,756,466	1.2
		<u>17,891,193</u>	<u>3.3</u>
		<u>140,961,035</u>	<u>25.8</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Samsung SDI Co., Ltd.	33,660	14,881,142	2.7
Sinbon Electronics Co., Ltd.	1,359,000	12,558,413	2.3
		<u>27,439,555</u>	<u>5.0</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
FPT Corp.	199,881	736,337	0.1
GDS Holdings Ltd. - Class A	2,671,480	9,123,860	1.7
Larsen & Toubro Infotech Ltd.	103,063	5,899,266	1.1
		<u>15,759,463</u>	<u>2.9</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
ASPEED Technology, Inc.	107,100	7,048,826	1.3
Broadcom, Inc.	17,380	8,674,532	1.6
MediaTek, Inc.	466,000	10,082,719	1.9
SK Hynix, Inc.	96,220	6,765,032	1.2
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	2,679,000	43,854,684	8.0
		<u>76,425,793</u>	<u>14.0</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Samsung Electronics Co., Ltd.	341,020	15,107,450	2.8
		<u>134,732,261</u>	<u>24.7</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank for Foreign Trade of Vietnam JSC	2,288,807	8,190,933	1.5
Bank Mandiri Persero Tbk PT	34,007,000	20,237,061	3.7
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	8,900,000	2,599,059	0.5
Grupo Financiero Banorte SAB de CV - Class O	1,331,510	7,864,874	1.4
HDFC Bank Ltd.	1,021,766	18,700,021	3.4
		<u>57,591,948</u>	<u>10.5</u>
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Housing Development Finance Corp., Ltd.	624,861	18,922,188	3.5
VERSICHERUNGEN			
AIA Group Ltd.	1,695,200	16,309,920	3.0
Max Financial Services Ltd.	746,394	7,667,518	1.4
		<u>23,977,438</u>	<u>4.4</u>
		<u>100,491,574</u>	<u>18.4</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Tencent Holdings Ltd.	744,800	30,783,164	5.6

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INDUSTRIEGÜTER					
BAU- UND INGENIEURWESEN					
Sinopec Engineering Group Co., Ltd. - Class H			20,694,500	\$ 9,245,680	1.7%
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG					
Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. - Class A			179,800	12,462,730	2.3
Ecopro BM Co., Ltd.			80,244	6,639,616	1.2
				<u>19,102,346</u>	<u>3.5</u>
				<u>28,348,026</u>	<u>5.2</u>
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA (Sponsored ADR)			110,310	10,995,701	2.0
METALL UND BERGBAU					
Freeport-McMoRan, Inc.			294,460	8,716,016	1.6
				<u>19,711,717</u>	<u>3.6</u>
GESUNDHEITSWESEN					
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN					
Universal Vision Biotechnology Co., Ltd.			617,400	6,428,775	1.1
PHARMAZEUTIKA					
Genomma Lab Internacional SAB de CV - Class B			11,247,696	9,189,540	1.7
				<u>15,618,315</u>	<u>2.8</u>
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
Equatorial Energia SA			3,182,500	14,791,798	2.7
VERBRAUCHSGÜTER					
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL					
Dino Polska SA			110,410	8,054,801	1.5
				<u>493,492,691</u>	<u>90.3</u>
AKTIENANLEIHEN					
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
FPT Corp. Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023			1,904,392	7,034,824	1.3
				<u>500,527,515</u>	<u>91.6</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
FINANZWERTE					
BANKEN					
Al Rajhi Bank			371,072	8,883,389	1.6
INDUSTRIEGÜTER					
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF					
Sunny Friend Environmental Technology Co., Ltd. (b)			1,334,000	7,940,691	1.5
STRASSE UND SCHIENE					
Globaltrans Investment PLC (Sponsored GDR) (b)			941,672	1	0.0
				<u>7,940,692</u>	<u>1.5</u>
				<u>16,824,081</u>	<u>3.1</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$563,548,911)				\$ 517,351,596	94.7%
Termineinlagen					
ANZ, London(c)	0.80 %	–		4,307	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(c)	1.37 %	–		109	0.0
BBH, Grand Cayman(c)	4.15 %	–		65,972	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	0.40 %	–		319,860	0.1
Credit Suisse AG, Zurich(c)	(0.58) %	–		1,072	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Singapore(c)	1.10 %	–		49,156	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(c)	(0.13) %	–		241,570	0.1
SEB, Stockholm(c)	0.19 %	–		85	0.0
Sumitomo, London(c)	0.87 %	–		134,013	0.0
Sumitomo, London(c)	1.68 %	–		24,693,232	4.5
Termineinlagen insgesamt				<u>25,509,376</u>	<u>4.7</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					
				<u>3,237,611</u>	<u>0.6</u>
Nettovermögen					
				<u>\$ 546,098,583</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	3,159	USD	2,237	09/12/2022	\$ 75,320
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN	1,012	USD	223	09/12/2022	7,923
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN	49	USD	10	09/12/2022	(172)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	37	USD	27	09/12/2022	531
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	4,204	AUD	6,017	09/12/2022	(86,048)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	221	PLN	1,049	09/12/2022	1,696
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	223	PLN	1,012	09/12/2022	(7,923)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	52	SGD	71	09/12/2022	(644)
						\$ (9,317)
					Wertsteigerung	\$ 85,470
					Wertminderung	\$ (94,787)

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

(c) 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 Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KRAFTFAHRZEUGE			
Great Wall Motor Co., Ltd. - Class H	7,792,000	\$ 11,794,177	2.4%
Hyundai Motor Co.	33,890	4,966,125	1.0
Kia Corp.	259,380	15,668,875	3.2
Maruti Suzuki India Ltd.	123,672	14,104,477	2.8
		<u>46,533,654</u>	<u>9.4</u>
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Galaxy Entertainment Group Ltd.	1,536,000	8,630,423	1.8
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	4,164,400	8,584,860	1.7
		<u>17,215,283</u>	<u>3.5</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai - Class A (Nth SZ-SEHK)	279,600	1,292,454	0.3
Midea Group Co., Ltd. - Class A	654,600	5,045,372	1.0
TCL Technology Group Corp. - Class A	1,845,300	1,108,649	0.2
		<u>7,446,475</u>	<u>1.5</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	1,771,700	21,286,495	4.3
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Matahari Department Store Tbk PT	7,511,100	1,938,185	0.4
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Mobile World Investment Corp.	507,500	1,601,834	0.3
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	1,347,000	6,392,874	1.3
		<u>7,994,708</u>	<u>1.6</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Samsonite International SA	4,882,200	11,968,037	2.4
		<u>114,382,837</u>	<u>23.1</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	12,406,500	7,125,849	1.4
Bank of the Philippine Islands	2,746,940	4,644,679	0.9
BOC Hong Kong Holdings Ltd.	1,855,000	6,404,946	1.3
CTBC Financial Holding Co., Ltd.	4,512,000	3,483,597	0.7
Dah Sing Financial Holdings Ltd.	694,200	1,852,981	0.4
Hana Financial Group, Inc.	347,410	10,194,641	2.1
KB Financial Group, Inc.	729,600	26,973,736	5.4
Metropolitan Bank & Trust Co.	3,038,880	2,846,498	0.6
Military Commercial Joint Stock Bank	1,949,880	1,975,246	0.4
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	562,700	4,868,183	1.0
State Bank of India	1,132,871	7,570,709	1.5
		<u>77,941,065</u>	<u>15.7</u>
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Metro Pacific Investments Corp.	35,522,000	2,359,488	0.5
VERSICHERUNGEN			
PICC Property & Casualty Co., Ltd. - Class H	3,126,000	3,385,402	0.7
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	1,606,000	9,484,131	1.9
		<u>12,869,533</u>	<u>2.6</u>
		<u>93,170,086</u>	<u>18.8</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
BOE Technology Group Co., Ltd. - Class A	10,153,800	5,438,880	1.1
GoerTek, Inc. - Class A	556,200	2,615,328	0.5
Luxshare Precision Industry Co., Ltd. - Class A	960,200	5,215,592	1.1
Tong Hsing Electronic Industries Ltd.	319,000	2,237,585	0.4
		<u>15,507,385</u>	<u>3.1</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
FPT Corp.	1,244,420	4,596,578	0.9
Vnet Group, Inc. (ADR)	798,400	4,271,440	0.9
		<u>8,868,018</u>	<u>1.8</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Novatek Microelectronics Corp.	613,000	5,306,793	1.1
Realtek Semiconductor Corp.	351,000	3,990,012	0.8
SK Hynix, Inc.	140,230	9,980,858	2.0
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	1,762,000	29,234,004	5.9

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
United Microelectronics Corp.	10,792,000	\$ 14,572,524	3.0%
		<u>63,084,191</u>	<u>12.8</u>
		<u>87,459,594</u>	<u>17.7</u>
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
Power Grid Corp. of India Ltd.	3,769,134	<u>10,886,438</u>	<u>2.2</u>
GASVERSORGUNGSBETRIEBE			
GAIL India Ltd.	5,427,076	9,295,775	1.9
Kunlun Energy Co., Ltd.	10,078,000	<u>8,795,635</u>	<u>1.7</u>
		<u>18,091,410</u>	<u>3.6</u>
UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN			
ACEN Corp.	436,080	58,242	0.0
China Datang Corp. Renewable Power Co., Ltd. - Class H	18,002,000	4,518,448	0.9
China Longyuan Power Group Corp., Ltd. - Class H	4,126,000	6,686,804	1.4
China Yangtze Power Co., Ltd. - Class A	1,312,000	4,554,724	0.9
Xinyi Energy Holdings Ltd.	9,688,000	<u>3,925,216</u>	<u>0.8</u>
		<u>19,743,434</u>	<u>4.0</u>
		<u>48,721,282</u>	<u>9.8</u>
IMMOBILIEN			
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)			
Frasers Centrepont Trust	1,462,300	<u>2,364,878</u>	<u>0.5</u>
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
Ayala Land, Inc.	12,559,000	6,407,539	1.3
China Resources Land Ltd.	1,482,000	6,089,480	1.2
CIFI Holdings Group Co., Ltd. (a)	10,062,264	2,564,059	0.5
CK Asset Holdings Ltd.	537,500	3,636,430	0.7
Country Garden Holdings Co., Ltd. (a)	5,463,000	1,621,770	0.3
Longfor Group Holdings Ltd.	1,912,000	6,236,345	1.3
Megaworld Corp.	31,599,000	1,406,776	0.3
Midea Real Estate Holding Ltd.	2,550,600	2,733,006	0.6
Times China Holdings Ltd. (a)	4,114,000	613,271	0.1
Vincom Retail JSC	2,206,100	2,606,482	0.5
Vinhomes JSC	935,700	<u>2,434,536</u>	<u>0.5</u>
		<u>36,349,694</u>	<u>7.3</u>
		<u>38,714,572</u>	<u>7.8</u>
INDUSTRIEGÜTER			
BAU- UND INGENIEURWESEN			
China State Construction Engineering Corp., Ltd. - Class A	1,699,700	<u>1,264,779</u>	<u>0.2</u>
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Jiangsu Zhongtian Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	960,500	3,095,292	0.6
Ming Yang Smart Energy Group Ltd. - Class A	773,400	3,004,028	0.6
NARI Technology Co., Ltd. - Class A	2,779,641	<u>11,046,130</u>	<u>2.3</u>
		<u>17,145,450</u>	<u>3.5</u>
INDUSTRIEKONZERNE			
Ayala Corp.	183,280	<u>2,291,204</u>	<u>0.5</u>
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
BOC Aviation Ltd.	571,000	<u>4,586,944</u>	<u>0.9</u>
		<u>25,288,377</u>	<u>5.1</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
HKT Trust & HKT Ltd. - Class SS	2,162,000	<u>2,903,345</u>	<u>0.6</u>
UNTERHALTUNG			
International Games System Co., Ltd.	398,000	<u>4,877,339</u>	<u>1.0</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Tencent Holdings Ltd.	310,900	<u>12,960,934</u>	<u>2.6</u>
MEDIEN			
Media Nusantara Citra TBK PT	43,406,500	<u>2,675,893</u>	<u>0.5</u>
		<u>23,417,511</u>	<u>4.7</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Hansol Chemical Co., Ltd.	52,450	8,568,147	1.7
Shanghai Putailai New Energy Technology Co., Ltd. - Class A	250,600	<u>2,299,389</u>	<u>0.5</u>
		<u>10,867,536</u>	<u>2.2</u>
BAUMATERIAL			
Gansu Shangfeng Cement Co., Ltd. - Class A	478,620	1,013,018	0.2
Huaxin Cement Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	353,100	<u>887,415</u>	<u>0.2</u>
		<u>1,900,433</u>	<u>0.4</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
METALL UND BERGBAU					
Ganfeng Lithium Co., Ltd. - Class H (a)			451,680	\$ 3,990,980	0.8%
Zijin Mining Group Co., Ltd. - Class H			5,058,000	5,761,275	1.1
				<u>9,752,255</u>	<u>1.9</u>
				<u>22,520,224</u>	<u>4.5</u>
ENERGIE					
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE					
China Oilfield Services Ltd. - Class H			11,502,000	11,958,199	2.4
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
PetroChina Co., Ltd. - Class H			15,372,000	7,266,187	1.5
				<u>19,224,386</u>	<u>3.9</u>
VERBRAUCHSGÜTER					
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Uni-President Enterprises Corp.			1,562,000	3,387,006	0.7
				<u>476,285,875</u>	<u>96.1</u>
AKTIENANLEIHEN					
IMMOBILIEN					
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG					
Vincom Retail, Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023			3,701,260	4,372,061	0.9
Vinhomes JSC, Macquarie Bank Ltd., expiring 07/15/2024			526,800	1,370,646	0.3
				<u>5,742,707</u>	<u>1.2</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
FPT Corp., Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023			1,499,628	5,538,071	1.1
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL					
Mobile World Investment Corp., Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023			459,900	1,451,593	0.3
FINANZWERTE					
BANKEN					
Military Commercial Joint Stock Bank, Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023			922,827	934,832	0.2
				<u>13,667,203</u>	<u>2.8</u>
Gesamtanlagen				<u>\$ 489,953,078</u>	<u>98.9%</u>
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	0.80 %	–		2,221	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	1.65 %	–		4	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	4.15 %	–		6,234	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b)	0.40 %	–		41,326	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Singapore(b)	1.10 %	–		50,142	0.0
Sumitomo, London(b)	0.87 %	–		28	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	1.68 %	–		2,530,314	0.5
Termineinlagen insgesamt				<u>2,630,269</u>	<u>0.5</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>2,757,131</u>	<u>0.6</u>
Nettovermögen				<u>\$ 495,340,478</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 35,754	USD 25,334	09/12/2022	\$ 865,416
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 6,253	USD 4,889	09/12/2022	127,462
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 388	USD 402	09/12/2022	11,841
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 10	USD 10	09/12/2022	(34)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 3,606	USD 4,413	09/12/2022	222,439
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 6,382	USD 4,089	09/12/2022	184,348
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 66	USD 48	09/12/2022	971
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 48,755	AUD 69,803	09/12/2022	(985,193)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 9,513	CAD 12,264	09/12/2022	(175,333)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 388	EUR 386	09/12/2022	94
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 402	EUR 388	09/12/2022	(11,841)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 8,463	GBP 7,028	09/12/2022	(296,517)

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	7,856	NZD	12,486	09/12/2022	\$ (216,951)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	93	SGD	128	09/12/2022	(1,165)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	24,209	ZAR	402,304	09/12/2022	(741,874)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	206,409	USD	12,727	09/12/2022	686,386
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CNH	2	USD	0*	09/19/2022	2
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CNH	1	USD	0*	09/19/2022	(1)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	0*	CNH	1	09/19/2022	1
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	13	CNH	91	09/19/2022	(210)
						\$ (330,159)
					Wertsteigerung	\$ 2,098,960
					Wertminderung	\$ (2,429,119)

+ 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
- 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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INDUSTRIEGÜTER			
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Park24 Co., Ltd.	68,800	¥ 137,324,800	2.0%
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Fuji Electric Co., Ltd.	16,300	98,941,000	1.5
INDUSTRIEKONZERNE			
Hitachi Ltd.	30,400	212,678,400	3.2
MASCHINEN			
Amada Co., Ltd.	61,100	67,026,700	1.0
IHI Corp. (a)	19,700	73,579,500	1.1
Toyota Industries Corp.	15,900	124,338,000	1.9
		264,944,200	4.0
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Dip Corp. (a)	30,600	111,078,000	1.6
Outsourcing, Inc.	75,400	92,138,800	1.4
UT Group Co., Ltd.	42,400	119,016,800	1.8
		322,233,600	4.8
STRASSE UND SCHIENE			
East Japan Railway Co.	17,600	127,406,400	1.9
Sankyu, Inc.	22,000	94,490,000	1.4
		221,896,400	3.3
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Mitsubishi Corp.	35,800	163,391,200	2.4
		1,421,409,600	21.2
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
NGK Spark Plug Co., Ltd.	40,600	116,359,600	1.7
Sumitomo Electric Industries Ltd. (a)	86,500	138,616,250	2.1
Toyo Tire Corp.	47,100	79,787,400	1.2
TS Tech Co., Ltd.	43,300	67,721,200	1.0
		402,484,450	6.0
KRAFTFAHRZEUGE			
Honda Motor Co., Ltd. (a)	47,900	178,379,600	2.7
Suzuki Motor Corp.	39,900	194,672,100	2.9
Toyota Motor Corp.	59,000	123,988,500	1.8
		497,040,200	7.4
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Sony Group Corp.	16,900	188,181,500	2.8
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
ASKUL Corp.	69,800	128,920,600	1.9
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
ABC-Mart, Inc. (a)	11,600	65,076,000	1.0
Shimamura Co., Ltd.	2,900	36,656,000	0.5
		101,732,000	1.5
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Asics Corp.	27,200	69,686,400	1.1
		1,388,045,150	20.7
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Ok Electric Industry Co., Ltd.	133,600	100,600,800	1.5
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
BIPROGY, Inc.	50,700	157,170,000	2.3
Fujitsu Ltd.	2,400	39,756,000	0.6
NEC Networks & System Integration Corp.	62,600	109,174,400	1.6
Otsuka Corp.	31,800	144,054,000	2.2
		450,154,400	6.7
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Rorze Corp.	6,600	56,562,000	0.9
SCREEN Holdings Co., Ltd.	12,300	115,374,000	1.7
		171,936,000	2.6
		722,691,200	10.8

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
VERBRAUCHSGÜTER					
GETRÄNKE					
Asahi Group Holdings Ltd.			21,436	¥ 100,170,428	1.5%
Kirin Holdings Co., Ltd.			45,700	104,858,650	1.6
				<u>205,029,078</u>	<u>3.1</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL					
Seven & i Holdings Co., Ltd.			23,700	131,132,100	1.9
Sundrug Co., Ltd.			24,800	84,568,000	1.3
				<u>215,700,100</u>	<u>3.2</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Morinaga & Co. Ltd./Japan			1,370	5,452,600	0.1
Nichirei Corp.			48,300	120,315,300	1.8
				<u>125,767,900</u>	<u>1.9</u>
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE					
Pola Orbis Holdings, Inc.			48,200	74,613,600	1.1
				<u>621,110,678</u>	<u>9.3</u>
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
Air Water, Inc.			63,500	111,125,000	1.7
Tosoh Corp.			68,500	123,779,500	1.8
Zeon Corp.			125,400	168,412,200	2.5
				<u>403,316,700</u>	<u>6.0</u>
CONTAINER UND VERPACKUNGEN					
Rengo Co., Ltd.			172,800	142,041,600	2.1
METALL UND BERGBAU					
Sumitomo Metal Mining Co., Ltd.			15,000	66,075,000	1.0
				<u>611,433,300</u>	<u>9.1</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE					
Nippon Telegraph & Telephone Corp.			88,300	332,802,700	5.0
UNTERHALTUNG					
Konami Holdings Corp.			18,400	130,272,000	1.9
MEDIEN					
Kadokawa Corp.			31,300	95,152,000	1.4
				<u>558,226,700</u>	<u>8.3</u>
FINANZWERTE					
BANKEN					
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			267,300	192,750,030	2.9
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.			51,600	216,410,400	3.2
				<u>409,160,430</u>	<u>6.1</u>
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN					
ORIX Corp.			55,400	127,198,400	1.9
				<u>536,358,830</u>	<u>8.0</u>
IMMOBILIEN					
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG					
Daito Trust Construction Co., Ltd.			6,400	87,936,000	1.3
Mitsui Fudosan Co., Ltd.			66,600	188,045,100	2.8
				<u>275,981,100</u>	<u>4.1</u>
GESUNDHEITSWESEN					
PHARMAZEUTIKA					
Nippon Shinyaku Co., Ltd.			24,500	187,425,000	2.8
Santen Pharmaceutical Co., Ltd.			70,100	70,520,600	1.1
				<u>257,945,600</u>	<u>3.9</u>
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
ENEOS Holdings, Inc. (a)			377,000	197,397,200	3.0
Gesamtanlagen					
(Kosten ¥6,353,563,361)				¥ 6,590,599,358	98.4%
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	0.80 %	–		39,435	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	1.10 %	–		2	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	1.65 %	–		22,722	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	4.15 %	–		210,466	0.0
JPMorgan Chase, New York(b)	1.68 %	–		2,574,077	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (JPY)	Nettovermögen %
Sumitomo, London(b)	(0.34)%	–		¥ 192,050,545	2.9%
Termineinlagen insgesamt				<u>194,897,247</u>	<u>2.9</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(89,413,241)</u>	<u>(1.3)</u>
Nettovermögen				<u>¥ 6,696,083,364</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 4,933	JPY 471,929	09/02/2022	¥ 2,985,007
Brown Brothers Harriman & Co.+	CZK 403	JPY 2,266	09/02/2022	(28,569)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 558	JPY 77,379	09/02/2022	(536,369)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 461,519	AUD 4,933	09/02/2022	7,425,246
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 2,249	CZK 403	09/02/2022	45,632
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 76,307	EUR 558	09/02/2022	1,607,513
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 50,344	NZD 596	09/02/2022	334,512
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 1,948	SGD 20	09/02/2022	60,523
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 760,966	USD 5,772	09/02/2022	40,871,692
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 38,312	ZAR 4,704	09/02/2022	(161,903)
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 596	JPY 50,839	09/02/2022	160,823
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 20	JPY 2,005	09/02/2022	(2,995)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 5,772	JPY 799,876	09/02/2022	(1,961,472)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 4,704	JPY 38,637	09/02/2022	486,478
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 66	JPY 6,314	09/12/2022	31,461
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 4,933	JPY 461,519	09/12/2022	(7,157,633)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CZK 408	JPY 2,279	09/12/2022	(41,336)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 573	JPY 78,320	09/12/2022	(1,632,405)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 461,520	AUD 4,934	09/12/2022	7,157,626
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 471,929	AUD 4,933	09/12/2022	(3,252,313)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 4,514	CZK 806	09/12/2022	65,018
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 154,810	EUR 1,124	09/12/2022	2,162,449
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 54,187	NZD 641	09/12/2022	234,356
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 52,164	NZD 612	09/12/2022	(200,021)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 3,953	SGD 40	09/12/2022	60,723
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 1,594,620	USD 11,795	09/12/2022	42,953,752
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 482	ZAR 60	09/12/2022	3,080
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 79,155	ZAR 9,679	09/12/2022	(779,122)
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 68	JPY 5,856	09/12/2022	63,183
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 596	JPY 50,344	09/12/2022	(295,760)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 20	JPY 1,975	09/12/2022	(59,222)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 6,101	JPY 805,475	09/12/2022	(41,601,907)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 5,032	JPY 40,994	09/12/2022	242,534
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 85	JPY 684	09/12/2022	(6,194)
				<u>¥ 49,234,387</u>
			Wertsteigerung	¥ 106,951,608
			Wertminderung	¥ (57,717,221)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KRAFTFAHRZEUGE			
Great Wall Motor Co., Ltd. - Class H	835,000	\$ 1,263,878	1.0%
Guangzhou Automobile Group Co., Ltd. - Class H	1,328,000	1,147,176	1.0
XPeng, Inc. (ADR)	38,370	710,612	0.6
		<u>3,121,666</u>	<u>2.6</u>
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Jiumaojiu International Holdings Ltd. (a)	981,000	1,942,327	1.6
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	1,643,200	3,387,437	2.8
		<u>5,329,764</u>	<u>4.4</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	593,360	7,129,059	5.9
JD.com, Inc. - Class A	139,026	4,371,631	3.6
Meituan - Class B	195,800	4,734,904	3.9
Pinduoduo, Inc. (ADR)	30,660	2,186,058	1.8
		<u>18,421,652</u>	<u>15.2</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Topsports International Holdings Ltd.	1,074,000	849,764	0.7
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	331,500	1,573,302	1.3
		<u>2,423,066</u>	<u>2.0</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Bosideng International Holdings Ltd.	3,082,000	1,735,630	1.4
Li Ning Co., Ltd.	358,500	3,288,697	2.7
Samsonite International SA	528,900	1,296,525	1.0
Shenzhou International Group Holdings Ltd.	89,000	933,804	0.8
Stella International Holdings Ltd.	1,642,000	1,914,241	1.6
		<u>9,168,897</u>	<u>7.5</u>
		<u>38,465,045</u>	<u>31.7</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank of Hangzhou Co., Ltd. - Class A	789,400	1,637,655	1.4
BOC Hong Kong Holdings Ltd.	342,000	1,180,858	1.0
China Construction Bank Corp. - Class H	6,819,100	4,231,149	3.5
China Merchants Bank Co., Ltd. - Class H	429,000	2,202,747	1.8
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A	354,400	877,855	0.7
Ping An Bank Co., Ltd. - Class A	1,016,436	1,876,158	1.5
		<u>12,006,422</u>	<u>9.9</u>
KAPITALMÄRKTE			
CITIC Securities Co., Ltd. - Class H	547,400	1,113,115	0.9
Haitong Securities Co., Ltd. - Class H	837,600	549,599	0.5
		<u>1,662,714</u>	<u>1.4</u>
VERSICHERUNGEN			
China Life Insurance Co., Ltd. - Class H	795,000	1,142,559	0.9
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	608,000	3,590,505	3.0
		<u>4,733,064</u>	<u>3.9</u>
		<u>18,402,200</u>	<u>15.2</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
UNTERHALTUNG			
G-bits Network Technology Xiamen Co., Ltd. - Class A	37,600	1,553,262	1.3
NetEase, Inc.	107,600	1,943,976	1.6
		<u>3,497,238</u>	<u>2.9</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Tencent Holdings Ltd.	308,100	12,844,206	10.6
MEDIEN			
Chinese Universe Publishing and Media Group Co., Ltd.	867,700	1,173,263	0.9
		<u>17,514,707</u>	<u>14.4</u>
INDUSTRIEGÜTER			
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. - Class A	17,700	1,237,655	1.0
Ming Yang Smart Energy Group Ltd. - Class A	339,200	1,317,515	1.1
NARI Technology Co., Ltd. - Class A	724,975	2,881,008	2.4
		<u>5,436,178</u>	<u>4.5</u>
INDUSTRIEKONZERNE			
Guoco Group Ltd.	91,000	869,571	0.7

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
MASCHINEN			
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co., Ltd. - Class A	122,500	\$ 978,227	0.8%
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
BOC Aviation Ltd.	165,400	1,328,687	1.1
		<u>8,612,663</u>	<u>7.1</u>
VERSORGUNG			
GASVERSORGUNGSBETRIEBE			
Kunlun Energy Co., Ltd.	4,370,000	3,813,944	3.1
UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN			
China Datang Corp. Renewable Power Co., Ltd. - Class H (a)	3,713,000	931,952	0.8
China Yangtze Power Co., Ltd. - Class A	364,000	1,263,658	1.0
Huaneng Lancang River Hydropower, Inc. - Class A (Nth SSE-SEHK)	981,700	1,033,219	0.9
Xinyi Energy Holdings Ltd. (a)	3,086,000	1,250,332	1.0
		<u>4,479,161</u>	<u>3.7</u>
		<u>8,293,105</u>	<u>6.8</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
China Resources Beer Holdings Co., Ltd.	172,000	1,202,008	1.0
Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A	7,900	2,200,449	1.8
Tsingtao Brewery Co., Ltd. - Class H	180,000	1,754,430	1.5
		<u>5,156,887</u>	<u>4.3</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Taiwan FamilyMart Co., Ltd./Taiwan	206,000	1,323,138	1.1
		<u>6,480,025</u>	<u>5.4</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
BOE Technology Group Co., Ltd. - Class A	1,772,200	949,278	0.8
GoerTek, Inc. - Class A	187,500	881,650	0.7
		<u>1,830,928</u>	<u>1.5</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
GDS Holdings Ltd. - Class A	515,260	1,788,938	1.5
Vnet Group, Inc. (ADR)	86,989	465,391	0.4
		<u>2,254,329</u>	<u>1.9</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
LONGi Green Energy Technology Co., Ltd. - Class A	169,700	1,257,856	1.0
		<u>5,343,113</u>	<u>4.4</u>
IMMOBILIEN			
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
China Resources Land Ltd.	354,000	1,454,572	1.2
Longfor Group Holdings Ltd. (a)	521,500	1,700,970	1.4
Midea Real Estate Holding Ltd.	682,000	730,773	0.6
Poly Developments and Holdings Group Co., Ltd. - Class A	513,300	1,285,572	1.1
		<u>5,171,887</u>	<u>4.3</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Shanghai Putailai New Energy Technology Co., Ltd. - Class A	123,000	1,128,591	0.9
Suzhou TA&A Ultra Clean Technology Co., Ltd.	103,600	1,170,009	1.0
Zhejiang Xinan Chemical Industrial Group Co., Ltd. - Class A	335,440	917,816	0.7
		<u>3,216,416</u>	<u>2.6</u>
METALL UND BERGBAU			
Zijin Mining Group Co., Ltd. - Class H	806,000	918,068	0.8
		<u>4,134,484</u>	<u>3.4</u>
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Chongqing Zhifei Biological Products Co., Ltd. - Class A	44,200	601,811	0.5
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd. - Class A	26,100	1,127,883	0.9
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd. - Class H	616,100	898,006	0.7
PHARMAZEUTIKA			
Yunnan Baiyao Group Co., Ltd. - Class A	155,400	1,177,958	1.0
		<u>3,805,658</u>	<u>3.1</u>
ENERGIE			
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
PetroChina Co., Ltd. - Class H	5,956,000	2,815,340	2.3

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
Gesamtanlagen					
(Kosten \$140,153,984).....				\$ 119,038,227	98.1%
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	0.80 %	–		7,183	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	1.10 %	–		1	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	1.37 %	–		1	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	1.65 %	–		513	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	4.15 %	–		19,565	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.40 %	–		46,952	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(0.58)%	–		13,181	0.0
JPMorgan Chase, New York(b)	1.68 %	–		3,714,346	3.1
Sumitomo, London(b)	(0.34)%	–		12,930	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.13)%	–		13,507	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>3,828,179</u>	<u>3.1</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(1,466,561)</u>	<u>(1.2)</u>
Nettovermögen				<u>\$ 121,399,845</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD 15,689	USD 11,122	09/12/2022	\$ 384,940
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CAD 1,041	USD 814	09/12/2022	21,679
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 256	USD 266	09/12/2022	7,832
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 5	USD 5	09/12/2022	(37)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	GBP 667	USD 817	09/12/2022	41,473
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	NZD 1,167	USD 748	09/12/2022	33,940
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	PLN 2,382	USD 524	09/12/2022	17,514
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	PLN 42	USD 9	09/12/2022	(132)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 32	USD 24	09/12/2022	482
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 21,678	AUD 30,931	09/12/2022	(509,571)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 1,595	CAD 2,051	09/12/2022	(33,464)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 9	EUR 9	09/12/2022	16
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 518	EUR 506	09/12/2022	(9,102)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 1,589	GBP 1,314	09/12/2022	(62,287)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 1,456	NZD 2,299	09/12/2022	(49,854)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 16	PLN 74	09/12/2022	122
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 1,018	PLN 4,709	09/12/2022	(18,044)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 46	SGD 63	09/12/2022	(677)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 29,762	ZAR 492,344	09/12/2022	(1,042,818)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR 250,721	USD 15,466	09/12/2022	841,159
				<u>\$ (376,829)</u>
			Wertsteigerung	\$ 1,349,157
			Wertminderung	\$ (1,725,986)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen 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
- 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

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
AUSTRALIEN					
Australia Government Bond, Series 139	3.25%	04/21/2025	AUD 8,852	\$ 6,060,343	1.3%
KANADA					
Canadian Government Bond, Series A55	8.00%	06/01/2023	CAD 16,329	12,821,084	2.7
ITALIEN					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	5.00%	03/01/2025	EUR 14,529	15,535,403	3.2
JAPAN					
Japan Government Twenty Year Bond, Series 64	1.90%	09/20/2023	JPY 951,947	6,998,069	1.4
Japan Government Twenty Year Bond, Series 65	1.90%	12/20/2023	2,973,376	21,963,206	4.6
				28,961,275	6.0
NEUSEELAND					
New Zealand Government Bond, Series 425	2.75%	04/15/2025	NZD 12,822	7,631,483	1.6
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds	7.13%	02/15/2023	USD 29,291	29,785,710	6.2
U.S. Treasury Bonds	7.50%	11/15/2024	38,552	41,780,637	8.7
U.S. Treasury Bonds	7.63%	02/15/2025	29,447	32,235,791	6.7
U.S. Treasury Notes	2.00%	08/15/2025	4,992	4,785,637	1.0
U.S. Treasury Notes	2.88%	11/30/2023	17,096	16,975,721	3.6
U.S. Treasury Notes	3.00%	07/31/2024	5,681	5,633,716	1.2
				131,197,212	27.4
				202,206,800	42.2
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV	1.25%	05/28/2025	EUR 2,048	1,979,230	0.4
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	1.38%	05/14/2025	1,463	1,417,167	0.3
Banco Santander SA	3.13%	10/06/2026	GBP 1,951	2,099,402	0.4
Bank of America Corp.	1.84%	02/04/2025	USD 2,072	1,991,812	0.4
Barclays PLC	0.75%	06/09/2025	EUR 537	515,730	0.1
Barclays PLC	2.89%	01/31/2027	983	951,382	0.2
Barclays PLC	3.38%	04/02/2025	605	608,900	0.1
BNP Paribas SA	1.13%	08/28/2024	1,853	1,810,146	0.4
BPCE SA	1.00%	04/01/2025	2,243	2,145,687	0.5
CaixaBank SA	0.63%	10/01/2024	1,756	1,671,892	0.4
Citigroup, Inc.	2.01%	01/25/2026	USD 2,083	1,957,919	0.4
Credit Agricole SA	0.38%	10/21/2025	EUR 2,048	1,915,685	0.4
Credit Suisse Group AG	6.37%	07/15/2026	USD 1,009	1,008,354	0.2
Danske Bank A/S	3.77%	03/28/2025	2,068	2,015,414	0.4
Deutsche Bank AG	3.88%	02/12/2024	GBP 1,073	1,210,587	0.3
Dnb Bank ASA	4.00%	08/17/2027	1,419	1,581,729	0.3
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	1.76%	01/24/2025	USD 2,082	2,000,417	0.4
HSBC Holdings PLC	1.65%	04/18/2026	2,117	1,930,345	0.4
Intesa Sanpaolo SpA	5.25%	01/12/2024	1,475	1,476,247	0.3
JPMorgan Chase & Co.	0.99%	04/28/2026	GBP 1,752	1,838,796	0.4
Lloyds Banking Group PLC	3.50%	04/01/2026	EUR 1,852	1,865,021	0.4
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	2.26%	06/14/2025	1,850	1,840,924	0.4
Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.	4.60%	03/27/2024	USD 1,241	1,235,564	0.3
Morgan Stanley	2.10%	05/08/2026	EUR 1,916	1,874,045	0.4
NatWest Markets PLC	0.13%	11/12/2025	2,075	1,903,723	0.4
Santander UK Group Holdings PLC	3.63%	01/14/2026	GBP 1,332	1,460,141	0.3
Standard Chartered PLC	2.82%	01/30/2026	USD 1,537	1,448,852	0.3
Swedbank AB	0.25%	10/09/2024	EUR 1,629	1,555,861	0.3
UBS Group AG	0.25%	01/29/2026	589	550,260	0.1
UBS Group AG	1.01%	07/30/2024	USD 433	419,755	0.1
UBS Group AG	4.49%	05/12/2026	1,072	1,062,290	0.2
				47,343,277	9.9
FINANZEN					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	1.65%	10/29/2024	2,119	1,963,638	0.4
Air Lease Corp.	3.88%	07/03/2023	1,267	1,263,151	0.3
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	1,184	1,140,745	0.2
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024	759	739,251	0.2
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	485	475,303	0.1
JAB Holdings BV	1.25%	05/22/2024	EUR 2,048	1,999,700	0.4
Synchrony Financial	4.50%	07/23/2025	USD 1,199	1,172,045	0.2
				8,753,833	1.8

AB FCP I
Short Duration Bond Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSICHERUNGEN					
Berkshire Hathaway, Inc.	0.00%	03/12/2025	EUR 2,118	\$ 2,008,810	0.4%
Metropolitan Life Global Funding I	1.75%	05/25/2025	1,897	1,877,041	0.4
				<u>3,885,851</u>	<u>0.8</u>
REITs					
Digital Dutch Finco BV	0.63%	07/15/2025	2,149	1,993,747	0.4
Heimstaden Bostad Treasury BV	0.25%	10/13/2024	528	485,759	0.1
Host Hotels & Resorts LP, Series E	4.00%	06/15/2025	USD 1,247	1,210,854	0.2
Omega Healthcare Investors, Inc.	4.95%	04/01/2024	1,234	1,236,168	0.3
				<u>4,926,528</u>	<u>1.0</u>
				<u>64,909,489</u>	<u>13.5</u>
INDUSTRIE					
INVESTITIONSGÜTER					
Johnson Controls International PLC	1.00%	09/15/2023	EUR 1,747	1,744,801	0.4
Parker-Hannifin Corp.	1.13%	03/01/2025	2,081	1,979,479	0.4
				<u>3,724,280</u>	<u>0.8</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
British Telecommunications PLC	4.50%	12/04/2023	USD 1,996	1,998,430	0.4
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
American Honda Finance Corp.	2.63%	10/14/2022	GBP 839	973,850	0.2
BMW Finance NV	0.50%	02/22/2025	EUR 749	721,825	0.2
General Motors Financial Co., Inc.	1.69%	03/26/2025	1,104	1,059,849	0.2
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	USD 1,560	1,495,429	0.3
Hyundai Capital America	1.25%	09/18/2023	526	508,562	0.1
Hyundai Capital America	2.85%	11/01/2022	1,543	1,540,210	0.3
Toyota Motor Credit Corp.	0.63%	11/21/2024	EUR 1,139	1,104,942	0.2
Toyota Motor Finance Netherlands BV	0.00%	10/27/2025	721	668,453	0.2
Volkswagen Financial Services AG	0.25%	01/31/2025	966	908,346	0.2
Volkswagen Leasing GmbH	1.13%	04/04/2024	908	893,659	0.2
				<u>9,875,125</u>	<u>2.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
PVH Corp.	4.63%	07/10/2025	USD 1,190	1,183,769	0.3
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Anheuser-Busch InBev SA/NV	9.75%	07/30/2024	GBP 1,282	1,628,186	0.3
Asahi Group Holdings Ltd.	0.16%	10/23/2024	EUR 1,961	1,878,490	0.4
Baxter International, Inc.	1.30%	05/30/2025	673	652,049	0.1
Becton Dickinson and Co.	0.00%	08/13/2023	734	724,180	0.2
Becton Dickinson and Co.	0.03%	08/13/2025	537	500,182	0.1
Cargill, Inc.	2.50%	02/15/2023	1,161	1,174,600	0.2
DH Europe Finance II SARL	0.20%	03/18/2026	2,164	1,993,835	0.4
Diageo Finance PLC	0.13%	10/12/2023	1,356	1,340,219	0.3
Medtronic Global Holdings SCA	0.00%	10/15/2025	1,816	1,693,838	0.4
				<u>11,585,579</u>	<u>2.4</u>
ENERGIE					
BP Capital Markets PLC	1.88%	04/07/2024	2,009	2,010,395	0.4
Cenovus Energy, Inc.	5.38%	07/15/2025	USD 1,168	1,198,465	0.2
Exxon Mobil Corp.	0.14%	06/26/2024	EUR 2,043	1,985,948	0.4
ONEOK, Inc.	2.20%	09/15/2025	USD 1,289	1,202,683	0.3
Repsol International Finance BV	0.13%	10/05/2024	EUR 1,463	1,409,759	0.3
Shell International Finance BV	0.38%	02/15/2025	1,790	1,715,914	0.4
				<u>9,523,164</u>	<u>2.0</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025	USD 1,147	1,176,974	0.2
TECHNOLOGIE					
Fidelity National Information Services, Inc.	0.75%	05/21/2023	EUR 1,987	1,984,566	0.4
Fiserv, Inc.	0.38%	07/01/2023	1,224	1,216,016	0.3
Honeywell International, Inc.	0.00%	03/10/2024	1,831	1,783,143	0.4
Take-Two Interactive Software, Inc.	3.30%	03/28/2024	USD 699	689,286	0.1
				<u>5,673,011</u>	<u>1.2</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
FedEx Corp.	0.45%	08/05/2025	EUR 2,057	1,948,433	0.4
Heathrow Funding Ltd.	5.23%	02/15/2023	GBP 1,336	1,557,331	0.3
				<u>3,505,764</u>	<u>0.7</u>
				<u>48,246,096</u>	<u>10.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
EDP Finance BV	8.63%	01/04/2024	GBP 927	\$ 1,136,244	0.2%
Electricite de France SA	4.63%	09/11/2024	EUR 1,609	1,694,835	0.4
Enel Finance International NV	0.00%	06/17/2024	549	530,411	0.1
Enel Finance International NV	0.00%	05/28/2026	824	739,516	0.2
Enel Finance International NV	2.65%	09/10/2024	USD 654	628,238	0.1
Engie SA	0.38%	02/28/2023	EUR 2,048	2,051,604	0.4
Scottish Power UK PLC	6.75%	05/29/2023	GBP 1,014	1,202,198	0.2
Western Power Distribution East Midlands PLC	5.25%	01/17/2023	1,475	1,720,794	0.4
				<u>9,703,840</u>	<u>2.0</u>
ERDGAS					
Southern Gas Networks PLC	4.88%	10/05/2023	1,156	1,348,296	0.3
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Thames Water Utilities Finance PLC	1.88%	01/24/2024	344	385,645	0.1
				<u>11,437,781</u>	<u>2.4</u>
				<u>124,593,366</u>	<u>26.0</u>
GEDECKTE ANLEIHEN					
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	0.25%	03/17/2025	EUR 1,310	1,252,399	0.3
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	0.45%	11/22/2023	1,144	1,129,627	0.2
Bank of Montreal	1.00%	04/05/2026	2,354	2,259,860	0.5
Bank of Nova Scotia (The)	0.01%	03/18/2025	2,311	2,192,572	0.5
Bank of Nova Scotia (The)	0.45%	03/16/2026	312	293,900	0.1
BPCE SFH SA	0.13%	03/31/2025	293	279,014	0.1
Caisse Francaise de Financement Local	0.01%	05/07/2025	3,707	3,516,522	0.7
CaixaBank SA	2.63%	03/21/2024	488	493,508	0.1
Cie de Financement Foncier SA	0.75%	05/29/2026	2,536	2,412,584	0.5
Commonwealth Bank of Australia	0.38%	04/11/2024	1,884	1,841,917	0.4
Commonwealth Bank of Australia	0.50%	07/27/2026	687	642,290	0.1
Credit Agricole Home Loan SFH SA	0.38%	09/30/2024	1,561	1,512,886	0.3
Credit Agricole Home Loan SFH SA	4.00%	07/16/2025	195	205,662	0.0
Danske Mortgage Bank PLC	0.01%	11/24/2026	182	167,029	0.0
DNB Boligkreditt AS	0.63%	06/19/2025	2,597	2,500,187	0.5
Korea Housing Finance Corp.	0.10%	06/18/2024	1,858	1,794,752	0.4
Lloyds Bank PLC	0.13%	06/18/2026	633	586,617	0.1
National Australia Bank Ltd.	0.63%	03/16/2027	400	370,594	0.1
National Australia Bank Ltd.	0.75%	01/30/2026	1,733	1,651,645	0.3
National Bank of Canada	0.38%	01/15/2024	285	279,926	0.1
National Bank of Canada	0.75%	03/13/2025	609	589,405	0.1
National Westminster Bank PLC	0.50%	05/15/2024	502	491,069	0.1
Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj	0.63%	05/23/2025	2,347	2,263,169	0.5
Royal Bank of Canada	0.63%	03/23/2026	2,350	2,225,441	0.5
Santander UK PLC	1.13%	03/12/2027	2,307	2,197,263	0.5
Skandinaviska Enskilda Banken AB	0.38%	02/09/2026	1,329	1,254,469	0.3
Skandinaviska Enskilda Banken AB, Series 580	1.00%	12/17/2025	SEK 13,656	1,187,805	0.2
Stadshypotek AB	0.38%	03/13/2026	EUR 358	337,375	0.1
Stadshypotek AB	0.50%	07/11/2025	2,192	2,100,191	0.4
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	0.55%	11/06/2023	1,887	1,862,456	0.4
Swedbank Hypotek AB	0.05%	05/28/2025	781	740,781	0.1
Westpac Banking Corp.	0.50%	05/17/2024	2,159	2,109,002	0.4
Westpac Banking Corp.	0.50%	01/16/2025	540	521,216	0.1
				<u>43,263,133</u>	<u>9.0</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN					
KANADA					
Province of Alberta Canada	0.63%	01/16/2026	2,200	2,099,547	0.4
Province of British Columbia Canada	4.25%	11/27/2024	AUD 4,555	3,129,354	0.7
Province of Ontario Canada	3.10%	08/26/2025	3,668	2,439,563	0.5
Province of Ontario Canada	4.25%	08/22/2024	3,472	2,384,287	0.5
Province of Ontario Canada, Series HP	8.10%	09/08/2023	CAD 2,097	1,663,122	0.3
Province of Quebec Canada	1.13%	10/28/2025	EUR 1,187	1,154,812	0.2
Province of Quebec Canada	4.20%	03/10/2025	AUD 5,314	3,650,907	0.8
Province of Quebec Canada	9.38%	01/16/2023	CAD 2,829	2,199,417	0.5
				<u>18,721,009</u>	<u>3.9</u>
INFLATIONSgebundene Wertpapiere					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Inflation Index	0.13%	07/15/2024	USD 10,036	9,883,854	2.1
U.S. Treasury Inflation Index	0.13%	10/15/2026	8,533	8,339,298	1.7
				<u>18,223,152</u>	<u>3.8</u>

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN						
FRANKREICH						
	Dexia Credit Local SA	1.25%	10/27/2025	EUR 3,609	\$ 3,525,860	0.7%
DEUTSCHLAND						
	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4.00%	02/27/2025	AUD 5,175	3,561,877	0.8
	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	5.00%	03/19/2024	2,593	1,811,328	0.4
	Landwirtschaftliche Rentenbank	0.00%	09/28/2026	EUR 3,292	3,054,027	0.6
					<u>8,427,232</u>	<u>1.8</u>
PHILIPPINEN						
	Philippine Government International Bond	0.00%	02/03/2023	1,000	997,078	0.2
SOUTH KOREA						
	South Korea	0.00%	10/15/2026	1,694	1,547,297	0.3
					<u>14,497,467</u>	<u>3.0</u>
SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN						
	European Investment Bank, Series EARN	0.38%	04/14/2026	5,774	5,487,925	1.2
	Nordic Investment Bank	0.50%	11/03/2025	2,193	2,099,659	0.4
	Nordic Investment Bank	4.75%	02/28/2024	AUD 3,232	2,249,158	0.5
					<u>9,836,742</u>	<u>2.1</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN						
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH						
Bellemeade Re Ltd.						
	Series 2018-3A, Class M1B(a)	4.29%	10/25/2028	USD 216	215,389	0.0
	Series 2019-3A, Class M1B(a)	4.04%	07/25/2029	231	231,123	0.1
Connecticut Avenue Securities Trust						
	Series 2021-R01, Class 1M1(a)	2.91%	10/25/2041	33	32,849	0.0
	Series 2021-R01, Class 1M2(a)	3.71%	10/25/2041	77	74,160	0.0
	Series 2021-R03, Class 1M1(a)	3.03%	12/25/2041	554	550,323	0.1
Eagle RE Ltd.						
	Series 2021-2, Class M1A(a)	3.71%	04/25/2034	146	145,925	0.0
	Series 2021-2, Class M1B(a)	4.21%	04/25/2034	296	293,134	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency						
Credit Risk Debt Notes						
	Series 2021-DNA5, Class M2(a)	3.83%	01/25/2034	280	278,608	0.1
	Series 2021-DNA6, Class M1(a)	2.98%	10/25/2041	56	54,941	0.0
	Series 2021-DNA6, Class M2(a)	3.68%	10/25/2041	792	748,678	0.2
	Series 2021-HQA4, Class M1(a)	3.13%	12/25/2041	786	762,523	0.2
	Series 2022-DNA3, Class M1A(a)	4.18%	04/25/2042	693	696,360	0.1
Federal National Mortgage Association Connecticut						
Avenue Securities						
	Series 2014-C04, Class 1M2(a)	7.34%	11/25/2024	653	683,318	0.1
	Series 2014-C04, Class 2M2(a)	7.44%	11/25/2024	139	140,713	0.0
	Series 2016-C02, Class 1M2(a)	8.44%	09/25/2028	389	407,942	0.1
	Series 2016-C03, Class 1M2(a)	7.74%	10/25/2028	574	582,935	0.1
	Home Re Ltd., Series 2019-1, Class M1(a)	4.09%	05/25/2029	673	670,374	0.1
	PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2019-2R, Class A(a)	5.24%	05/27/2023	408	400,428	0.1
	Radnor RE Ltd., Series 2019-2, Class M1B(a)	4.19%	06/25/2029	647	646,351	0.1
	Traingle Re Ltd., Series 2021-3, Class M1A(a)	4.08%	02/25/2034	732	717,866	0.2
					<u>8,333,940</u>	<u>1.7</u>
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN						
KANADA						
	Export Development Canada	0.25%	03/07/2026	EUR 266	250,769	0.1
JAPAN						
	Development Bank of Japan, Inc.	0.01%	10/15/2024	2,424	2,322,176	0.4
	Development Bank of Japan, Inc.	2.13%	09/01/2026	424	421,801	0.1
					<u>2,743,977</u>	<u>0.5</u>
NIEDERLANDE						
	BNG Bank NV	3.25%	07/15/2025	AUD 3,672	2,461,628	0.5
					<u>5,456,374</u>	<u>1.1</u>
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE						
QUASI-STAATSANLEIHEN						
SÜDKOREA						
	Export-Import Bank of Korea	0.83%	04/27/2025	EUR 1,234	1,195,479	0.2
	Korea Development Bank (The)	0.00%	07/10/2024	492	473,288	0.1
	Korea Development Bank (The)	1.50%	08/29/2024	AUD 1,951	1,260,842	0.3
					<u>2,929,609</u>	<u>0.6</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN						
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS						
	MSCG Trust, Series 2018-SELF, Class A(a)	3.29%	10/15/2037	USD 1,348	1,321,049	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal National Mortgage Association, Series 1999	7.00%	09/01/2029	USD	0* \$ 441	0.0%
Federal National Mortgage Association, Series 1999	7.00%	10/01/2029		1 1,180	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2000	7.00%	12/01/2030		1 800	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	09/01/2031		7 8,111	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	11/01/2031		3 3,175	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	12/01/2031		7 7,310	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	01/01/2032		1 1,472	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2002	7.00%	02/01/2032		1 1,439	0.0
				<u>23,928</u>	<u>0.0</u>
				449,406,569	93.7
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class A1(a)	3.87%	07/20/2034		1,605 1,562,424	0.3
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class A1(a)	3.88%	10/20/2034		1,116 1,083,337	0.2
Ballyrock CLO Ltd., Series 2021-16A, Class A1(a)	3.84%	07/20/2034		1,079 1,047,862	0.2
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class A1A(a)	4.21%	07/23/2032		1,435 1,409,152	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-42A, Class A(a)	3.84%	07/16/2035		1,398 1,365,348	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 43 Ltd., Series 2021-43A, Class A(a)	3.87%	07/17/2035		1,631 1,595,626	0.4
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class A(a)	3.89%	10/20/2034		993 956,797	0.2
				<u>9,020,546</u>	<u>1.9</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
American Medical Systems Europe BV	0.75%	03/08/2025	EUR	1,653 1,588,204	0.3
GSK Consumer Healthcare Capital NL BV	1.25%	03/29/2026		344 327,157	0.1
				<u>1,915,361</u>	<u>0.4</u>
				10,935,907	2.3
Gesamtanlagen				<u>\$ 460,342,476</u>	<u>96.0%</u>
(Kosten \$508,808,934)					
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	0.80 %	–		219,910	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(b)	1.37 %	–		50,099	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	1.65 %	–		46,865	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	4.15 %	–		1	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.80 %	–		49,617	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	1.10 %	–		50,230	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(0.58)%	–		2,387	0.0
DBS Bank Ltd, Singapore(b)	1.68 %	–		6,662,650	1.4
HSBC Bank PLC, Paris(b)	(0.13)%	–		264,509	0.1
Sumitomo, London(b)	0.87 %	–		47,026	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.13)%	–		534	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	1.68 %	–		21,590	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>7,415,418</u>	<u>1.5</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				11,816,904	2.5
Nettovermögen				<u>\$ 479,574,798</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
Korea 3 Yr Bond Futures	09/20/2022	190	\$ 14,662,581	\$ 14,715,196	\$ 52,615
Short					
Euro-BOBL Futures	09/08/2022	173	21,625,939	21,354,542	271,397
Euro-Schatz Futures	09/08/2022	383	42,308,378	41,840,018	468,360
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	12/30/2022	142	15,867,564	15,781,827	85,737
				<u>\$ 878,109</u>	

DEVISEINTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	EUR	14,232	USD	14,347	09/29/2022	\$ 17,635
Bank of America, NA.	CHF	3,652	USD	3,829	09/08/2022	91,191
Bank of America, NA.	JPY	326,185	USD	2,379	09/08/2022	30,300
Bank of America, NA.	USD	2,415	JPY	334,384	09/08/2022	(6,892)
Bank of America, NA.	USD	2,501	PLN	11,405	09/09/2022	(76,930)
Bank of America, NA.	EUR	26,905	USD	28,357	09/15/2022	1,295,328
Bank of America, NA.	SGD	6,984	USD	4,960	09/15/2022	(37,221)
Bank of America, NA.	USD	2,374	SGD	3,335	09/15/2022	12,713
Bank of America, NA.	USD	2,620	SGD	3,648	09/15/2022	(9,534)
Bank of America, NA.	SEK	62,453	USD	6,122	09/22/2022	257,851
Bank of America, NA.	USD	6,144	SEK	62,453	09/22/2022	(279,282)
Bank of America, NA.	JPY	1,534,548	USD	11,224	09/29/2022	154,164
Bank of America, NA.	USD	779	EUR	776	09/29/2022	2,410
Bank of America, NA.	USD	2,508	MXN	51,853	09/29/2022	52,681
Bank of America, NA.	JPY	333,454	USD	2,508	10/14/2022	99,085
Barclays Bank PLC	NOK	24,615	USD	2,511	09/22/2022	33,216
Barclays Bank PLC	USD	2,414	NOK	24,615	09/22/2022	63,756
Barclays Bank PLC	GBP	1,726	USD	2,010	11/17/2022	2,270
BNP Paribas SA.	PLN	11,627	USD	2,464	09/09/2022	(7,936)
BNP Paribas SA.	USD	23	PLN	107	09/09/2022	179
BNP Paribas SA.	USD	2,459	PLN	11,520	09/09/2022	(9,987)
BNP Paribas SA.	CLP	2,188,978	USD	2,437	09/15/2022	1,193
BNP Paribas SA.	SGD	3,455	USD	2,482	09/15/2022	9,773
BNP Paribas SA.	USD	1,414	CLP	1,254,797	09/15/2022	(17,489)
BNP Paribas SA.	USD	2,501	SGD	3,455	09/15/2022	(28,603)
BNP Paribas SA.	MXN	48,273	USD	2,394	09/29/2022	10,581
BNP Paribas SA.	USD	2,258	MXN	45,294	09/29/2022	(21,633)
BNP Paribas SA.	USD	2,522	CAD	3,240	10/27/2022	(56,161)
BNP Paribas SA.	NZD	15,597	USD	9,620	11/18/2022	78,888
BNP Paribas SA.	USD	2,480	NZD	4,046	11/18/2022	(4,653)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	3,644	JPY	491,066	09/08/2022	(107,288)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	4,780	JPY	655,068	09/29/2022	(54,637)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	35,643	USD	36,349	10/14/2022	426,852
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	7,135	USD	5,083	10/20/2022	197,445
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	1,394	USD	1,431	10/31/2022	24,041
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	30,465	USD	31,541	11/14/2022	771,520
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	36,506	USD	36,769	11/29/2022	(138,726)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	17,075	USD	12,106	09/12/2022	420,631
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD	7,497	USD	5,865	09/12/2022	156,976
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	5,257	USD	5,448	09/12/2022	162,121
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	4	USD	4	09/12/2022	(33)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	3,866	USD	4,734	09/12/2022	241,727
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD	670	USD	429	09/12/2022	19,664
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	709	USD	518	09/12/2022	10,765
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	21,277	AUD	30,405	09/12/2022	(469,336)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	11,536	CAD	14,897	09/12/2022	(193,368)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	5,299	EUR	5,321	09/12/2022	52,556
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	5,448	EUR	5,257	09/12/2022	(162,121)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	8,970	GBP	7,466	09/12/2022	(295,504)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	842	NZD	1,339	09/12/2022	(23,223)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	507	SGD	709	09/12/2022	16
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	518	SGD	709	09/12/2022	(10,765)
Citibank, NA.	PLN	11,429	USD	2,439	09/09/2022	9,559
Citibank, NA.	USD	2,434	PLN	11,429	09/09/2022	(4,736)
Citibank, NA.	SGD	3,408	USD	2,492	09/15/2022	53,218
Citibank, NA.	USD	2,409	CLP	2,490,459	09/15/2022	363,188
Citibank, NA.	USD	2,449	SGD	3,408	09/15/2022	(9,755)
Citibank, NA.	INR	102,092	USD	1,272	09/28/2022	(9,355)
Citibank, NA.	USD	7,306	INR	584,677	09/28/2022	31,371
Citibank, NA.	EUR	2,555	USD	2,628	09/29/2022	56,026
Citibank, NA.	EUR	3,860	USD	3,854	09/29/2022	(32,086)
Citibank, NA.	USD	1,973	EUR	1,938	09/29/2022	(21,617)
Citibank, NA.	AUD	3,416	USD	2,386	10/20/2022	47,039
Citibank, NA.	USD	2,348	AUD	3,416	10/20/2022	(9,249)
Citibank, NA.	CAD	32,138	USD	24,926	10/27/2022	463,723
Citibank, NA.	KRW	1,216,182	USD	927	10/27/2022	20,127
Citibank, NA.	USD	2,426	KRW	3,200,035	10/27/2022	(39,534)
Credit Suisse International.	SEK	74,962	USD	7,107	09/22/2022	67,500
Credit Suisse International.	USD	7,301	SEK	74,962	09/22/2022	(261,863)
Credit Suisse International.	AUD	6,444	USD	4,439	10/20/2022	26,615
Credit Suisse International.	USD	4,465	AUD	6,444	10/20/2022	(52,879)
Goldman Sachs Bank USA.	CHF	2,440	USD	2,526	09/08/2022	27,847

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Goldman Sachs Bank USA	USD 2,497	CHF 2,440	09/08/2022	\$ 850
Goldman Sachs Bank USA	PLN 11,094	USD 2,362	09/09/2022	4,008
Goldman Sachs Bank USA	USD 2,282	PLN 11,094	09/09/2022	76,284
Goldman Sachs Bank USA	USD 2,404	PLN 11,119	09/09/2022	(40,744)
Goldman Sachs Bank USA	NOK 25,509	USD 2,602	09/22/2022	34,536
Goldman Sachs Bank USA	SEK 52,079	USD 5,007	09/22/2022	116,752
Goldman Sachs Bank USA	USD 2,490	NOK 25,509	09/22/2022	77,513
Goldman Sachs Bank USA	USD 5,015	SEK 52,079	09/22/2022	(124,225)
HSBC Bank USA	JPY 464,890	USD 3,407	09/08/2022	59,201
HSBC Bank USA	CLP 3,754,020	USD 3,990	09/15/2022	(188,264)
HSBC Bank USA	INR 404,403	USD 5,051	09/28/2022	(23,750)
HSBC Bank USA	USD 2,536	INR 200,204	09/28/2022	(23,484)
HSBC Bank USA	KRW 3,328,081	USD 2,540	10/27/2022	58,523
HSBC Bank USA	USD 2,444	KRW 3,199,378	10/27/2022	(58,013)
JPMorgan Chase Bank, NA	JPY 2,169,313	USD 16,160	09/08/2022	538,150
JPMorgan Chase Bank, NA	PLN 11,829	USD 2,527	09/09/2022	12,712
JPMorgan Chase Bank, NA	PLN 11,124	USD 2,316	09/09/2022	(48,705)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 44	PLN 209	09/09/2022	353
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 2,507	PLN 11,620	09/09/2022	(36,748)
JPMorgan Chase Bank, NA	SGD 3,703	USD 2,674	09/15/2022	24,696
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 1,290	SGD 1,814	09/15/2022	8,529
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 1,357	SGD 1,889	09/15/2022	(5,400)
JPMorgan Chase Bank, NA	NOK 50,637	USD 5,266	09/22/2022	169,102
JPMorgan Chase Bank, NA	NOK 25,260	USD 2,541	09/22/2022	(1,801)
JPMorgan Chase Bank, NA	SEK 26,262	USD 2,494	09/22/2022	27,449
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 2,476	NOK 25,260	09/22/2022	66,475
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 9,933	NOK 97,288	09/22/2022	(140,026)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 4,871	SEK 51,603	09/22/2022	(25,378)
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR 2,776	USD 2,770	09/29/2022	(25,423)
JPMorgan Chase Bank, NA	MXN 49,034	USD 2,409	09/29/2022	(11,605)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 2,369	MXN 49,034	09/29/2022	51,676
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 18,919	AUD 27,506	10/20/2022	(84,148)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 2,532	CAD 3,255	10/27/2022	(54,418)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 2,310	NZD 3,722	11/18/2022	(32,683)
Morgan Stanley & Co. International PLC	SEK 12,538	USD 1,229	09/22/2022	51,615
Morgan Stanley & Co. International PLC	INR 89,524	USD 1,112	09/28/2022	(11,873)
Morgan Stanley & Co. International PLC	EUR 693	USD 708	09/29/2022	10,676
Morgan Stanley & Co. International PLC	JPY 332,342	USD 2,436	09/29/2022	38,288
Morgan Stanley & Co. International PLC	MXN 101,589	USD 4,899	09/29/2022	(117,339)
Morgan Stanley & Co. International PLC	USD 2,400	JPY 323,802	09/29/2022	(63,719)
Morgan Stanley & Co. International PLC	USD 4,992	MXN 101,589	09/29/2022	23,642
Morgan Stanley & Co. International PLC	AUD 3,489	USD 2,432	10/20/2022	42,939
Morgan Stanley & Co. International PLC	KRW 3,247,121	USD 2,449	10/27/2022	27,458
Royal Bank of Scotland PLC	JPY 679,635	USD 5,191	09/29/2022	288,602
Royal Bank of Scotland PLC	USD 1,437	CNH 9,853	10/20/2022	(9,547)
Royal Bank of Scotland PLC	USD 2,494	CAD 3,215	10/27/2022	(46,888)
Royal Bank of Scotland PLC	GBP 14,248	USD 16,932	11/17/2022	356,166
Standard Chartered Bank	USD 2,415	INR 192,280	09/28/2022	(1,958)
Standard Chartered Bank	EUR 12,042	USD 12,292	10/14/2022	156,282
UBS AG	CHF 1,227	USD 1,276	09/08/2022	20,963
UBS AG	CHF 2,432	USD 2,487	09/08/2022	(2,554)
UBS AG	USD 5,170	CHF 4,981	09/08/2022	(72,914)
UBS AG	SEK 49,832	USD 4,783	09/22/2022	103,564
UBS AG	USD 2,406	SEK 24,228	09/22/2022	(131,119)
UBS AG	MXN 52,756	USD 2,592	09/29/2022	(12,508)
UBS AG	USD 2,562	MXN 52,756	09/29/2022	42,378
UBS AG	AUD 95,648	USD 66,075	10/20/2022	582,232
UBS AG	CNH 9,840	USD 1,451	10/20/2022	25,798
UBS AG	USD 19,574	AUD 28,284	10/20/2022	(207,213)
				\$ 4,906,310
			Wertsteigerung	\$ 8,961,153
			Wertminderung	\$ (4,054,843)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	NZD 13,731	11/02/2024	3 Month BKBM	2.503%	\$ (313,208)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	NZD 12,631	11/10/2024	3 Month BKBM	2.448%	(299,141)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	NZD 5,134	11/01/2024	3 Month BKBM	2.580%	(111,616)
					\$ (723,965)

* Kapitalbetrag geringer als 500.

(a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. August 2022.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

- BKBM – Bank Bill Benchmark (New Zealand)
- 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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Advanced Drainage Systems, Inc.	5.00%	09/30/2027	USD 2,804	\$ 2,692,978	0.0%
ASP Unifrax Holdings, Inc.	5.25%	09/30/2028	11,675	9,519,285	0.1
ASP Unifrax Holdings, Inc.	7.50%	09/30/2029	4,318	3,210,805	0.0
Avient Corp.	5.75%	05/15/2025	7,156	7,055,328	0.1
Avient Corp.	7.13%	08/01/2030	9,591	9,484,881	0.1
Axalta Coating Systems LLC	3.38%	02/15/2029	3,163	2,661,194	0.0
Big River Steel LLC/BRS Finance Corp.	6.63%	01/31/2029	20,800	20,846,490	0.1
Cheever Escrow Issuer LLC	7.13%	10/01/2027	9,353	9,009,114	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	4.63%	03/01/2029	8,053	7,154,974	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	4.88%	03/01/2031	8,434	7,375,130	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026	2,020	2,042,953	0.0
CVR Partners LP/CVR Nitrogen Finance Corp.	6.13%	06/15/2028	14,545	13,508,163	0.1
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.38%	04/01/2031	1,000	829,849	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	3,648	3,323,446	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	6.13%	04/15/2032	37,477	34,749,919	0.2
Glatfelter Corp.	4.75%	11/15/2029	11,574	7,206,364	0.1
Graham Packaging Co., Inc.	7.13%	08/15/2028	6,383	5,483,493	0.0
Guala Closures SpA.	3.25%	06/15/2028	EUR 700	593,114	0.0
Hecla Mining Co.	7.25%	02/15/2028	USD 25,670	24,460,503	0.2
Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV, Inc.	9.00%	07/01/2028	19,086	16,694,066	0.1
Ingevity Corp.	3.88%	11/01/2028	1,000	862,521	0.0
Intelligent Packaging Holdco Issuer LP(a)	9.00%	01/15/2026	12,133	10,047,566	0.1
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./ Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	29,516	25,332,105	0.2
Mercer International, Inc.	5.13%	02/01/2029	20,091	17,537,760	0.1
Monitchem HoldCo 3 SA.	5.25%	03/15/2025	EUR 100	94,547	0.0
Olin Corp.	5.00%	02/01/2030	USD 1,000	922,403	0.0
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	19,555	18,634,077	0.1
PIC AU Holdings LLC/PIC AU Holdings Corp.	10.00%	12/31/2024	313	316,912	0.0
SCIH Salt Holdings, Inc.	6.63%	05/01/2029	1,000	823,068	0.0
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	4.38%	11/01/2026	EUR 5,856	4,890,577	0.0
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	5.38%	11/01/2026	USD 21,559	17,889,086	0.1
Valvoline, Inc.	6.63%	06/15/2031	1,000	804,623	0.0
Valvoline, Inc.	4.25%	02/15/2030	25,506	24,893,981	0.2
Vibrantz Technologies, Inc.	9.00%	02/15/2030	55,708	40,879,202	0.3
WR Grace Holdings LLC	4.88%	06/15/2027	21,036	19,548,353	0.1
				<u>371,378,830</u>	<u>2.6</u>
INVESTITIONSGÜTER					
ARD Finance SA(a)	5.00%	06/30/2027	EUR 14,174	10,543,265	0.1
ARD Finance SA(a)	6.50%	06/30/2027	USD 15,519	12,131,811	0.1
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC	2.00%	09/01/2028	EUR 700	577,721	0.0
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC	4.00%	09/01/2029	USD 1,000	820,000	0.0
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC	6.00%	06/15/2027	4,931	4,828,435	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	2.13%	08/15/2026	EUR 700	566,017	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	4.13%	08/15/2026	USD 1,000	863,299	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	08/15/2027	1,000	728,750	0.0
Bombardier, Inc.	7.50%	12/01/2024	13,024	12,980,937	0.1
Bombardier, Inc.	7.50%	03/15/2025	32,725	32,038,227	0.2
Bombardier, Inc.	7.88%	04/15/2027	541	517,503	0.0
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	2,611	2,449,029	0.0
Eco Material Technologies, Inc.	7.88%	01/31/2027	32,988	30,592,761	0.2
EnerSys	4.38%	12/15/2027	18,085	16,615,093	0.1
F-Brasile SpA/F-Brasile US LLC, Series XR	7.38%	08/15/2026	20,200	16,403,206	0.1
Gates Global LLC/Gates Corp.	6.25%	01/15/2026	25,892	24,532,670	0.2
GFL Environmental, Inc.	3.50%	09/01/2028	1,000	870,070	0.0
GFL Environmental, Inc.	4.75%	06/15/2029	18,492	16,160,006	0.1
Granite US Holdings Corp.	11.00%	10/01/2027	27,965	27,233,727	0.2
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	28,956	26,789,014	0.2
Harsco Corp.	5.75%	07/31/2027	11,787	8,375,354	0.1
IMA Industria Macchine Automatiche SpA.	3.75%	01/15/2028	EUR 700	579,075	0.0
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	USD 2,036	1,753,035	0.0
LSB Industries, Inc.	6.25%	10/15/2028	9,141	8,460,383	0.1
Madison IAQ LLC	5.88%	06/30/2029	41,603	34,260,464	0.2
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	7,075	6,480,594	0.0
Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025	EUR 15,007	14,145,362	0.1
SPX FLOW, Inc.	8.75%	04/01/2030	USD 40,012	33,322,192	0.2
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp.	5.25%	01/15/2029	3,336	3,032,782	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Tervita Corp.	11.00%	12/01/2025	USD 16,302	\$ 17,686,728	0.1%
Titan Holdings II BV	5.13%	07/15/2029	EUR 12,355	10,558,908	0.1
TK Elevator Holdco GmbH	7.63%	07/15/2028	USD 7,893	7,071,227	0.1
TK Elevator Midco GmbH	4.38%	07/15/2027	EUR 1,200	1,061,732	0.0
TK Elevator US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	USD 15,684	14,274,967	0.1
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024	7,229	6,624,907	0.1
Triumph Group, Inc.	7.75%	08/15/2025	8,167	6,890,863	0.1
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024	13,567	13,676,416	0.1
Trivium Packaging Finance BV	3.75%	08/15/2026	EUR 2,266	2,153,509	0.0
Wesco Distribution, Inc.	7.13%	06/15/2025	USD 31,560	31,688,534	0.2
Wesco Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	10,669	10,771,779	0.1
				471,110,352	3.3
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Adevinta ASA	3.00%	11/15/2027	EUR 700	630,571	0.0
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	USD 36,810	31,657,923	0.2
Altice Financing SA.	4.25%	08/15/2029	EUR 700	569,671	0.0
Altice Financing SA.	5.75%	08/15/2029	USD 73,220	59,082,943	0.4
Arches Buyer, Inc.	6.13%	12/01/2028	8,568	6,703,235	0.1
Banjay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025	6,576	6,214,810	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.25%	01/15/2034	22,642	17,237,077	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	21,000	17,674,148	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.75%	02/01/2032	17,214	14,256,732	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.00%	02/01/2028	1,000	912,913	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	6.38%	09/01/2029	10,989	10,670,336	0.1
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	21,181	19,009,307	0.1
CSC Holdings LLC	5.00%	11/15/2031	15,534	11,151,779	0.1
CSC Holdings LLC	5.38%	02/01/2028	1,000	903,819	0.0
CSC Holdings LLC	5.50%	04/15/2027	6,197	5,871,984	0.1
CSC Holdings LLC	5.75%	01/15/2030	27,306	21,137,466	0.2
CSC Holdings LLC	6.50%	02/01/2029	1,000	920,114	0.0
CSC Holdings LLC	7.50%	04/01/2028	17,996	16,017,512	0.1
DISH DBS Corp.	5.00%	03/15/2023	36,424	35,686,989	0.3
DISH DBS Corp.	5.25%	12/01/2026	27,259	22,538,362	0.2
DISH DBS Corp.	5.75%	12/01/2028	30,009	23,096,934	0.2
DISH DBS Corp.	5.88%	11/15/2024	4,019	3,668,212	0.0
DISH Network Corp.(b).	3.38%	08/15/2026	6,494	4,698,116	0.0
Gray Escrow II, Inc.	5.38%	11/15/2031	31,385	26,535,195	0.2
Gray Television, Inc.	5.88%	07/15/2026	2,000	1,930,910	0.0
Gray Television, Inc.	7.00%	05/15/2027	1,000	987,047	0.0
iHeartCommunications, Inc.	4.75%	01/15/2028	6,435	5,517,882	0.1
iHeartCommunications, Inc.	5.25%	08/15/2027	10,448	9,407,292	0.1
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026	2,630	2,487,059	0.0
iHeartCommunications, Inc.	8.38%	05/01/2027	4,768	4,195,091	0.0
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029	2,301	2,147,993	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	20,019	18,917,731	0.1
Liberty Interactive LLC(b)	3.75%	02/15/2030	11,908	5,666,745	0.1
McGraw-Hill Education, Inc.	5.75%	08/01/2028	38,388	33,707,330	0.2
McGraw-Hill Education, Inc.	8.00%	08/01/2029	20,010	17,359,675	0.1
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026	6,800	3,400,963	0.0
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028	12,566	8,869,292	0.1
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp.	4.63%	03/15/2030	10,335	8,628,491	0.1
Scripps Escrow II, Inc.	3.88%	01/15/2029	1,000	848,148	0.0
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	23,135	18,135,453	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	4.00%	07/15/2028	58,351	50,891,515	0.4
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029	1,000	935,612	0.0
Summer BC Bidco B LLC	5.50%	10/31/2026	6,800	5,917,635	0.1
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	EUR 19,048	17,713,739	0.1
TEGNA, Inc.	4.75%	03/15/2026	USD 4,806	4,732,423	0.0
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029	18,735	17,949,822	0.1
Univision Communications, Inc.	4.50%	05/01/2029	5,371	4,696,033	0.0
Univision Communications, Inc.	5.13%	02/15/2025	1,681	1,623,663	0.0
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	29,088	28,166,370	0.2
Univision Communications, Inc.	7.38%	06/30/2030	13,794	13,685,784	0.1
UPCB Finance VII Ltd.	3.63%	06/15/2029	EUR 700	614,490	0.0
Urban One, Inc.	7.38%	02/01/2028	USD 49,053	44,235,947	0.3
Virgin Media Finance PLC	3.75%	07/15/2030	EUR 700	549,455	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	4.50%	08/15/2030	USD 4,000	3,327,179	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	5.00%	04/15/2027	GBP 2,000	2,140,131	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	05/15/2029	USD 1,952	1,751,745	0.0
Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC	5.00%	07/15/2028	USD 2,300	1,970,276	0.0
VZ Secured Financing BV	3.50%	01/15/2032	EUR 6,945	5,410,076	0.0
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	USD 4,484	3,589,271	0.0
Ziggo Bond Co. BV	6.00%	01/15/2027	2,820	2,557,119	0.0
Ziggo BV	2.88%	01/15/2030	EUR 2,374	1,908,007	0.0
				713,419,542	5.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France SA/France	5.13%	07/15/2029	USD 8,692	\$ 6,743,596	0.0%
Altice France SA/France	5.88%	02/01/2027	EUR 1,200	1,094,150	0.0
Altice France SA/France	8.13%	02/01/2027	USD 8,421	7,974,281	0.1
Arqiva Broadcast Finance PLC	6.75%	09/30/2023	GBP 6,698	7,750,798	0.1
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026	USD 40,626	37,172,790	0.2
Consolidated Communications, Inc.	5.00%	10/01/2028	16,110	12,463,153	0.1
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	24,110	19,645,147	0.1
DKT Finance ApS	7.00%	06/17/2023	EUR 8,954	8,761,740	0.1
DKT Finance ApS	9.38%	06/17/2023	USD 23,497	22,636,905	0.1
Embarq Corp.	8.00%	06/01/2036	32,601	25,227,274	0.1
Frontier Communications Holdings LLC	5.88%	10/15/2027	16,401	15,334,490	0.1
Frontier Communications Holdings LLC	6.75%	05/01/2029	12,000	10,351,861	0.1
Hughes Satellite Systems Corp.	6.63%	08/01/2026	13,000	12,289,636	0.1
Iliad Holding SASU	5.13%	10/15/2026	EUR 2,998	2,852,802	0.0
Iliad Holding SASU	6.50%	10/15/2026	USD 11,478	10,516,575	0.1
Iliad Holding SASU	7.00%	10/15/2028	8,644	7,961,163	0.1
Kaixo Bondco Telecom SA	5.13%	09/30/2029	EUR 18,989	15,521,819	0.1
Level 3 Financing, Inc.	3.75%	07/15/2029	USD 13,050	10,502,050	0.1
Level 3 Financing, Inc.	4.25%	07/01/2028	7,061	5,874,146	0.0
Level 3 Financing, Inc.	4.63%	09/15/2027	19,656	17,352,171	0.1
Lorca Telecom Bondco SA	4.00%	09/18/2027	EUR 9,462	8,501,625	0.1
Lumen Technologies, Inc.	5.63%	04/01/2025	USD 1,000	971,214	0.0
Nexstar Media, Inc.	5.63%	07/15/2027	11,783	11,227,967	0.1
Telecom Italia Capital SA	6.00%	09/30/2034	2,000	1,617,829	0.0
Telecom Italia Capital SA	7.20%	07/18/2036	31,658	27,015,905	0.2
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	13,001	11,227,524	0.1
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.75%	07/15/2031	42,248	34,682,716	0.2
Zayo Group Holdings, Inc.	6.13%	03/01/2028	17,177	13,160,321	0.1
				<u>366,431,648</u>	<u>2.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Allison Transmission, Inc.	5.88%	06/01/2029	7,094	6,713,525	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.25%	03/15/2026	1,790	1,737,472	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.50%	04/01/2027	1,890	1,766,473	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.88%	07/01/2028	15,455	14,686,466	0.1
Aston Martin Capital Holdings Ltd.	10.50%	11/30/2025	33,751	34,235,737	0.2
Aston Martin Capital Holdings Ltd.(a)	15.00%	11/30/2026	14,533	15,992,179	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	4.38%	05/15/2026	EUR 3,111	2,888,142	0.0
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	6.25%	05/15/2026	USD 5,621	5,560,009	0.0
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	8.50%	05/15/2027	37,834	37,190,315	0.3
Dana, Inc.	5.38%	11/15/2027	232	207,011	0.0
Dana, Inc.	5.63%	06/15/2028	3,358	3,020,721	0.0
Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC	8.00%	02/01/2028	34,435	31,936,963	0.2
Faurecia SE	2.75%	02/15/2027	EUR 17,744	14,630,383	0.1
Ford Motor Co.	6.10%	08/19/2032	USD 59,885	58,398,483	0.4
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.00%	07/15/2029	6,459	5,792,934	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.25%	07/15/2031	5,865	5,057,651	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(a)	3.75%	09/15/2026	EUR 1,111	979,349	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(a)	6.00%	05/15/2027	USD 15,335	13,647,859	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a)	6.38%	05/15/2029	15,335	13,536,831	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	2.20%	01/15/2024	EUR 3,000	2,720,435	0.0
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.50%	07/15/2029	USD 10,597	7,770,936	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	11/15/2024	EUR 8,944	8,231,811	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	01/15/2028	USD 28,297	21,511,705	0.2
Jaguar Land Rover Automotive PLC	7.75%	10/15/2025	24,649	23,119,528	0.2
Mclaren Finance PLC	7.50%	08/01/2026	40,320	34,195,060	0.2
Meritor, Inc.	6.25%	06/01/2025	7,776	8,019,000	0.1
PM General Purchaser LLC	9.50%	10/01/2028	28,314	25,047,661	0.2
Real Hero Merger Sub 2, Inc.	6.25%	02/01/2029	21,039	17,227,903	0.1
Tenneco, Inc.	5.00%	07/15/2026	31,522	30,173,785	0.2
Tenneco, Inc.	5.13%	04/15/2029	3,375	3,313,009	0.0
Tenneco, Inc.	7.88%	01/15/2029	6,003	6,035,871	0.0
Titan International, Inc.	7.00%	04/30/2028	24,723	23,641,424	0.2
ZF Europe Finance BV	3.00%	10/23/2029	EUR 9,500	7,122,823	0.1
ZF Finance GmbH	2.00%	05/06/2027	700	561,229	0.0
ZF Finance GmbH	2.25%	05/03/2028	8,700	6,572,591	0.1
ZF Finance GmbH	3.75%	09/21/2028	4,300	3,507,622	0.0
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025	USD 33,093	31,201,146	0.2
				<u>527,952,042</u>	<u>3.7</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	4.00%	08/01/2028	15,210	12,624,300	0.1
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	29,310	22,788,525	0.1
Carnival Corp.	7.63%	03/01/2026	EUR 6,154	5,247,976	0.0
Carnival Corp.	9.88%	08/01/2027	USD 13,439	13,465,206	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Carnival Corp.	10.13%	02/01/2026	EUR 6,153	\$ 6,397,807	0.0%
Carnival Corp.	10.50%	02/01/2026	USD 1,000	1,027,550	0.0
Cedar Fair LP.	5.25%	07/15/2029	2,000	1,820,326	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.	5.50%	05/01/2025	41,998	41,315,289	0.3
Lindblad Expeditions LLC	6.75%	02/15/2027	9,468	8,621,852	0.1
Mattel, Inc.	5.88%	12/15/2027	3,598	3,588,702	0.0
Motion Bondco DAC.	4.50%	11/15/2027	EUR 13,300	10,718,266	0.1
NCL Corp., Ltd.	5.88%	03/15/2026	USD 29,640	23,725,335	0.2
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.38%	07/15/2027	16,520	12,844,300	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	08/31/2026	18,015	14,356,874	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	04/01/2028	13,254	10,006,770	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	10.88%	06/01/2023	25,951	26,357,393	0.2
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025	28,450	30,194,269	0.2
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	8.75%	05/01/2025	19,206	19,930,674	0.1
Six Flags Theme Parks, Inc.	7.00%	07/01/2025	4,141	4,186,949	0.0
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025	6,640	6,652,933	0.0
Viking Cruises Ltd.	5.88%	09/15/2027	29,535	23,793,021	0.2
Viking Cruises Ltd.	7.00%	02/15/2029	11,973	9,601,896	0.1
Viking Cruises Ltd.	13.00%	05/15/2025	12,492	13,116,607	0.1
				322,382,820	2.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025	16,531	14,427,150	0.1
Beazer Homes USA, Inc.	6.75%	03/15/2025	21,605	20,649,554	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	4.88%	02/15/2030	26,127	20,191,374	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027	19,888	17,686,879	0.1
Builders FirstSource, Inc.	6.38%	06/15/2032	20,332	18,863,806	0.1
Caesars Entertainment, Inc.	6.25%	07/01/2025	22,343	21,814,597	0.2
Churchill Downs, Inc.	5.50%	04/01/2027	2,000	1,924,649	0.0
CP Atlas Buyer, Inc.	7.00%	12/01/2028	14,319	11,688,261	0.1
Empire Communities Corp.	7.00%	12/15/2025	6,172	5,308,448	0.0
Everi Holdings, Inc.	5.00%	07/15/2029	3,865	3,410,371	0.0
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp.	7.88%	11/15/2025	32,611	28,911,356	0.2
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.38%	05/01/2025	5,320	5,270,814	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.75%	05/01/2028	5,733	5,607,412	0.0
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc.	4.88%	07/01/2031	16,956	14,004,979	0.1
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc.	5.00%	06/01/2029	14,836	13,130,850	0.1
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	5,705	5,274,636	0.0
International Game Technology PLC	5.25%	01/15/2029	512	476,842	0.0
International Game Technology PLC	6.25%	01/15/2027	9,125	8,948,000	0.1
International Game Technology PLC	6.50%	02/15/2025	23,261	23,188,284	0.2
KB Home	4.80%	11/15/2029	5,544	4,730,297	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc.	4.50%	06/15/2029	9,893	8,309,142	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc.	6.13%	09/15/2025	6,973	6,965,831	0.1
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	28,097	22,672,765	0.2
NH Hotel Group SA.	4.00%	07/02/2026	EUR 1,921	1,787,254	0.0
Premier Entertainment Sub LLC/ Premier Entertainment Finance Corp.	5.63%	09/01/2029	USD 7,382	5,456,551	0.0
Premier Entertainment Sub LLC/ Premier Entertainment Finance Corp.	5.88%	09/01/2031	20,595	14,400,343	0.1
Samsonite Finco SARL	3.50%	05/15/2026	EUR 700	631,533	0.0
Scientific Games International, Inc.	7.00%	05/15/2028	USD 7,525	7,393,057	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	10,577	8,823,861	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	04/01/2029	14,461	11,668,479	0.1
Standard Industries, Inc./NJ.	4.38%	07/15/2030	1,000	794,371	0.0
Standard Industries, Inc./NJ.	5.00%	02/15/2027	1,000	921,052	0.0
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP/ Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp.	5.88%	05/15/2025	22,618	21,157,385	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	14,127	13,033,186	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	11,351	10,974,066	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc./ Taylor Morrison Holdings II, Inc.	5.88%	04/15/2023	15,712	15,613,800	0.1
Travel & Leisure Co.	6.00%	04/01/2027	4,000	3,806,111	0.0
Travel + Leisure Co.	4.50%	12/01/2029	16,710	13,585,049	0.1
Travel + Leisure Co.	4.63%	03/01/2030	15,276	12,467,445	0.1
Travel + Leisure Co.	6.63%	07/31/2026	29,164	28,280,186	0.2
Victors Merger Corp.	6.38%	05/15/2029	38,070	25,713,425	0.2
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.25%	05/15/2027	18,930	17,069,544	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	19,690	16,529,685	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	7.75%	04/15/2025	9,543	9,516,024	0.1
				523,078,704	3.6

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
IRB Holding Corp.....	7.00%	06/15/2025	USD 10,678	\$ 10,748,954	0.1%
Papa John's International, Inc.....	3.88%	09/15/2029	5,437	4,659,583	0.0
				<u>15,408,537</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Arko Corp.....	5.13%	11/15/2029	18,547	15,515,771	0.1
Asbury Automotive Group, Inc.....	4.63%	11/15/2029	16,345	14,019,739	0.1
Asbury Automotive Group, Inc.....	5.00%	02/15/2032	7,235	6,044,405	0.1
Bath & Body Works, Inc.....	5.25%	02/01/2028	3,551	3,187,438	0.0
Bath & Body Works, Inc.....	6.63%	10/01/2030	8,014	7,283,435	0.1
Bath & Body Works, Inc.....	6.75%	07/01/2036	11,880	10,253,332	0.1
Bath & Body Works, Inc.....	6.88%	11/01/2035	13,781	12,043,218	0.1
Bath & Body Works, Inc.....	6.95%	03/01/2033	13,864	11,417,299	0.1
Bath & Body Works, Inc.....	7.50%	06/15/2029	5,283	5,081,832	0.0
Bath & Body Works, Inc.....	7.60%	07/15/2037	4,421	3,652,943	0.0
Bath & Body Works, Inc.....	9.38%	07/01/2025	1,656	1,752,200	0.0
BCPE Ulysses Intermediate, Inc.(a).....	7.75%	04/01/2027	19,207	14,412,585	0.1
Carvana Co.....	5.50%	04/15/2027	2,126	1,379,804	0.0
Carvana Co.....	5.88%	10/01/2028	6,595	3,961,023	0.0
Dufry One BV.....	2.00%	02/15/2027	EUR 1,063	866,655	0.0
Dufry One BV.....	2.50%	10/15/2024	17,530	16,615,262	0.1
Dufry One BV.....	3.38%	04/15/2028	4,079	3,386,278	0.0
FirstCash, Inc.....	4.63%	09/01/2028	USD 1,000	878,824	0.0
FirstCash, Inc.....	5.63%	01/01/2030	21,145	18,919,720	0.1
Foundation Building Materials, Inc.....	6.00%	03/01/2029	5,396	4,413,624	0.0
Gap, Inc. (The).....	3.63%	10/01/2029	5,357	3,727,143	0.0
Gap, Inc. (The).....	3.88%	10/01/2031	4,852	3,368,308	0.0
Kontoor Brands, Inc.....	4.13%	11/15/2029	23,553	20,154,264	0.2
LBM Acquisition LLC.....	6.25%	01/15/2029	7,137	5,353,861	0.0
Michaels Cos, Inc. (The).....	7.88%	05/01/2029	55,224	36,691,767	0.3
Murphy Oil USA, Inc.....	5.63%	05/01/2027	1,441	1,423,285	0.0
NMG Holding Co., Inc./Neiman Marcus Group LLC.....	7.13%	04/01/2026	34,569	32,452,242	0.2
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.....	4.75%	02/15/2028	6,641	5,977,123	0.1
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.....	7.75%	02/15/2029	38,041	35,712,768	0.3
Rite Aid Corp.....	7.50%	07/01/2025	16,583	14,170,567	0.1
Rite Aid Corp.....	8.00%	11/15/2026	21,400	17,470,085	0.1
Sonic Automotive, Inc.....	4.63%	11/15/2029	4,532	3,850,868	0.0
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp.....	6.38%	09/30/2026	19,813	17,626,917	0.1
SRS Distribution, Inc.....	6.13%	07/01/2029	6,009	4,936,226	0.0
Staples, Inc.....	7.50%	04/15/2026	15,503	13,105,750	0.1
Staples, Inc.....	10.75%	04/15/2027	43,095	31,742,515	0.2
TPro Acquisition Corp.....	11.00%	10/15/2024	16,176	16,149,474	0.1
White Cap Buyer LLC.....	6.88%	10/15/2028	29,658	26,102,506	0.2
White Cap Parent LLC(a).....	8.25%	03/15/2026	7,186	6,268,962	0.1
				<u>451,370,018</u>	<u>3.1</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
AdaptHealth LLC.....	4.63%	08/01/2029	1,000	819,731	0.0
AdaptHealth LLC.....	5.13%	03/01/2030	24,648	21,167,775	0.2
AdaptHealth LLC.....	6.13%	08/01/2028	5,430	5,104,996	0.0
AHP Health Partners, Inc.....	5.75%	07/15/2029	20,045	15,938,740	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.....	4.63%	01/15/2027	12,062	11,054,573	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.....	4.88%	02/15/2030	7,984	7,000,024	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.....	5.88%	02/15/2028	1,000	953,107	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.....	7.50%	03/15/2026	5,667	5,802,119	0.0
Avantor Funding, Inc.....	3.88%	07/15/2028	EUR 700	644,175	0.0
Bausch Health Americas, Inc.....	8.50%	01/31/2027	USD 15,514	7,442,840	0.1
Bausch Health Americas, Inc.....	9.25%	04/01/2026	5,000	2,998,280	0.0
Bausch Health Cos., Inc.....	5.75%	08/15/2027	3,475	2,539,041	0.0
Bausch Health Cos., Inc.....	6.25%	02/15/2029	9,519	3,592,629	0.0
Bausch Health Cos., Inc.....	7.25%	05/30/2029	9,800	3,611,636	0.0
Bausch Health Cos., Inc.....	9.00%	12/15/2025	6,654	4,275,516	0.0
Cab Selas.....	3.38%	02/01/2028	EUR 4,291	3,600,721	0.0
CD&R Smokey Buyer, Inc.....	6.75%	07/15/2025	USD 11,430	10,680,904	0.1
Cheplapharm Arzneimittel GmbH.....	3.50%	02/11/2027	EUR 700	630,392	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.....	5.63%	03/15/2027	USD 7,408	6,282,964	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.....	6.00%	01/15/2029	7,082	5,863,052	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.....	6.13%	04/01/2030	17,452	10,803,274	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.....	6.88%	04/01/2028	2,000	1,044,423	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.....	6.88%	04/15/2029	33,534	20,924,036	0.2
Darling Ingredients, Inc.....	6.00%	06/15/2030	11,280	11,290,982	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
DaVita, Inc.	4.63%	06/01/2030	USD 38,000	\$ 30,470,145	0.2%
Elanco Animal Health, Inc.	6.40%	08/28/2028	2,000	1,859,924	0.0
Garden Spinco Corp.	8.63%	07/20/2030	13,172	14,020,853	0.1
Global Medical Response, Inc.	6.50%	10/01/2025	29,645	26,643,100	0.2
Grifols Escrow Issuer SA.	3.88%	10/15/2028	EUR 12,604	10,127,378	0.1
Grifols Escrow Issuer SA.	4.75%	10/15/2028	USD 12,153	10,301,195	0.1
IQVIA, Inc.	2.25%	03/15/2029	EUR 700	583,876	0.0
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc.	7.00%	12/31/2027	USD 55,853	46,094,072	0.3
Lamb Weston Holdings, Inc.	4.13%	01/31/2030	1,000	900,714	0.0
Legacy LifePoint Health LLC.	4.38%	02/15/2027	1,000	869,323	0.0
Legacy LifePoint Health LLC.	6.75%	04/15/2025	1,667	1,636,568	0.0
LifePoint Health, Inc.	5.38%	01/15/2029	3,000	2,274,317	0.0
Mallinckrodt International Finance SA/Mallinckrodt CB LLC.	10.00%	06/15/2029	2,284	1,153,420	0.0
Medline Borrower LP.	3.88%	04/01/2029	23,239	19,677,269	0.1
Medline Borrower LP.	5.25%	10/01/2029	40,404	33,961,677	0.2
ModivCare Escrow Issuer, Inc.	5.00%	10/01/2029	3,999	3,550,338	0.0
ModivCare, Inc.	5.88%	11/15/2025	3,735	3,539,474	0.0
Option Care Health, Inc.	4.38%	10/31/2029	20,312	17,889,819	0.1
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	2.88%	04/30/2028	EUR 1,200	1,068,570	0.0
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	5.13%	04/30/2031	USD 11,076	9,692,044	0.1
Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029	26,783	24,551,636	0.2
Post Holdings, Inc.	5.63%	01/15/2028	3,097	2,942,192	0.0
Radiology Partners, Inc.	9.25%	02/01/2028	36,585	27,452,751	0.2
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc./ LifePoint Health, Inc.	9.75%	12/01/2026	47,895	45,774,372	0.3
RP Escrow Issuer LLC.	5.25%	12/15/2025	9,009	8,126,595	0.1
Tenet Healthcare Corp.	6.13%	10/01/2028	3,049	2,795,482	0.0
Tenet Healthcare Corp.	6.13%	06/15/2030	13,559	13,020,528	0.1
Tenet Healthcare Corp.	6.25%	02/01/2027	5,000	4,820,278	0.0
Triton Water Holdings, Inc.	6.25%	04/01/2029	16,820	13,797,903	0.1
US Acute Care Solutions LLC.	6.38%	03/01/2026	14,091	12,699,385	0.1
US Foods, Inc.	4.63%	06/01/2030	10,566	9,118,579	0.1
US Renal Care, Inc.	10.63%	07/15/2027	27,853	13,362,339	0.1
				578,842,046	4.0
ENERGIE					
Antero Resources Corp.	7.63%	02/01/2029	1,453	1,478,018	0.0
Apache Corp.	4.25%	01/15/2030	10,000	9,036,291	0.1
Athabasca Oil Corp.	9.75%	11/01/2026	15,883	16,597,735	0.1
Berry Petroleum Co. LLC.	7.00%	02/15/2026	9,146	8,596,765	0.1
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.63%	12/15/2025	13,168	13,162,593	0.1
Callon Petroleum Co.	8.00%	08/01/2028	18,463	17,720,889	0.1
Callon Petroleum Co.	8.25%	07/15/2025	6,693	6,571,290	0.0
Citgo Holding, Inc.	9.25%	08/01/2024	31,077	30,954,185	0.2
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	11,351	10,912,379	0.1
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	37,747	36,829,479	0.3
Civitas Resources, Inc.	5.00%	10/15/2026	2,989	2,821,524	0.0
CNX Resources Corp.	6.00%	01/15/2029	11,727	11,032,942	0.1
CNX Resources Corp.	7.25%	03/14/2027	3,321	3,300,876	0.0
Comstock Resources, Inc.	5.88%	01/15/2030	3,578	3,295,513	0.0
Comstock Resources, Inc.	6.75%	03/01/2029	14,500	13,855,733	0.1
CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC.	5.50%	06/15/2031	24,829	21,971,597	0.2
Crescent Energy Finance LLC.	7.25%	05/01/2026	12,658	12,102,035	0.1
Diamond Foreign Asset Co./Diamond Finance LLC(a)	9.00%	04/22/2027	2,012	1,926,926	0.0
Encino Acquisition Partners Holdings LLC.	8.50%	05/01/2028	25,563	24,391,480	0.2
EnLink Midstream LLC.	5.63%	01/15/2028	14,782	14,216,671	0.1
EnLink Midstream Partners LP.	4.15%	06/01/2025	1,667	1,632,933	0.0
EnLink Midstream Partners LP.	4.40%	04/01/2024	1,257	1,260,868	0.0
EnLink Midstream Partners LP.	5.05%	04/01/2045	12,856	9,284,192	0.1
EnLink Midstream Partners LP.	5.45%	06/01/2047	8,848	6,757,842	0.1
EnLink Midstream Partners LP.	5.60%	04/01/2044	10,151	8,052,962	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	5.63%	06/15/2024	10,368	9,974,981	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.25%	05/15/2026	6,765	6,177,846	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.50%	10/01/2025	13,124	12,216,272	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	20,791	19,386,955	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	8.00%	01/15/2027	14,401	13,645,012	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	6.88%	01/15/2029	8,328	7,646,460	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	08/01/2027	8,217	7,822,122	0.1
Gulfport Energy Corp.	8.00%	05/17/2026	11,726	11,902,314	0.1
Harbour Energy PLC.	5.50%	10/15/2026	10,197	9,321,580	0.1
Hess Midstream Operations LP.	4.25%	02/15/2030	2,753	2,373,878	0.0
Hess Midstream Operations LP.	5.63%	02/15/2026	10,815	10,545,213	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.75%	02/01/2029	4,680	4,300,232	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.00%	02/01/2031	9,196	8,331,719	0.1
Ithaca Energy North Sea PLC.	9.00%	07/15/2026	6,175	6,028,971	0.0
ITT Holdings LLC.	6.50%	08/01/2029	36,941	31,331,381	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Moss Creek Resources Holdings, Inc.	7.50%	01/15/2026	USD 44,211	\$ 40,303,945	0.3%
Nabors Industries Ltd.	7.25%	01/15/2026	15,170	13,799,956	0.1
Nabors Industries Ltd.	7.50%	01/15/2028	20,724	18,662,214	0.1
Nabors Industries, Inc.	7.38%	05/15/2027	20,521	19,803,113	0.1
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	21,236	20,542,642	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	02/01/2026	37,092	33,577,922	0.2
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp.	6.13%	03/01/2025	2,000	1,633,407	0.0
Occidental Petroleum Corp.	2.70%	02/15/2023	16,135	15,999,971	0.1
Occidental Petroleum Corp.	5.50%	12/01/2025	5,236	5,374,767	0.0
Occidental Petroleum Corp.	5.88%	09/01/2025	4,883	5,009,146	0.0
Occidental Petroleum Corp.	6.13%	01/01/2031	3,743	3,898,032	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.00%	07/15/2025	7,644	8,283,063	0.1
Occidental Petroleum Corp.	8.50%	07/15/2027	3,851	4,314,468	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.88%	07/15/2030	8,851	10,356,031	0.1
PDC Energy, Inc.	5.75%	05/15/2026	12,397	11,875,361	0.1
PDC Energy, Inc.	6.13%	09/15/2024	6,662	6,641,979	0.1
Range Resources Corp.	5.00%	03/15/2023	2,996	2,991,097	0.0
SM Energy Co.	6.63%	01/15/2027	2,000	1,950,033	0.0
SM Energy Co.	6.75%	09/15/2026	8,555	8,395,745	0.1
Southwestern Energy Co.	5.38%	02/01/2029	18,012	17,047,080	0.1
Southwestern Energy Co.	8.38%	09/15/2028	4,053	4,267,060	0.0
Summit Midstream Holdings LLC/ Summit Midstream Finance Corp.	8.50%	10/15/2026	18,457	17,936,441	0.1
Sunnova Energy Corp.	5.88%	09/01/2026	12,285	11,377,914	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	5.88%	03/15/2028	26,261	24,571,068	0.2
Talos Production, Inc.	12.00%	01/15/2026	18,356	19,444,683	0.1
Transocean Phoenix 2 Ltd.	7.75%	10/15/2024	9,365	9,193,506	0.1
Transocean Poseidon Ltd.	6.88%	02/01/2027	875	829,217	0.0
Transocean, Inc.	7.50%	01/15/2026	7,747	6,061,501	0.0
Transocean, Inc.	11.50%	01/30/2027	5,345	5,153,009	0.0
Venture Global Calcasieu Pass LLC	4.13%	08/15/2031	4,979	4,340,826	0.0
W&T Offshore, Inc.	9.75%	11/01/2023	12,581	12,496,482	0.1
Weatherford International Ltd.	11.00%	12/01/2024	99	100,237	0.0
				<u>815,000,570</u>	<u>5.7</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2027	EUR 700	636,942	0.0
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2031	19,101	15,218,541	0.1
Interface, Inc.	5.50%	12/01/2028	USD 4,882	4,318,586	0.0
				<u>20,174,069</u>	<u>0.1</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
ADT Security Corp. (The)	4.13%	08/01/2029	1,000	857,765	0.0
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp. ...	6.00%	06/01/2029	13,593	10,183,340	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp. ...	6.63%	07/15/2026	22,051	20,643,149	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp. ...	9.75%	07/15/2027	20,978	19,170,327	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL	4.63%	06/01/2028	1,098	920,450	0.0
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL	4.88%	06/01/2028	GBP 8,760	8,163,785	0.1
ANGI Group LLC	3.88%	08/15/2028	USD 16,418	12,453,823	0.1
APCOA Parking Holdings GmbH	4.63%	01/15/2027	EUR 8,760	7,212,337	0.1
Aptim Corp.	7.75%	06/15/2025	USD 34,041	23,650,950	0.2
APX Group, Inc.	5.75%	07/15/2029	48,964	40,157,366	0.3
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	8,465	8,305,162	0.1
Aramark Services, Inc.	6.38%	05/01/2025	20,566	20,331,192	0.1
Arena Luxembourg Finance SARL	1.88%	02/01/2028	EUR 700	540,707	0.0
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	USD 16,622	14,954,558	0.1
Elis SA	1.63%	04/03/2028	EUR 700	593,138	0.0
Garda World Security Corp.	4.63%	02/15/2027	USD 2,000	1,758,145	0.0
Garda World Security Corp.	6.00%	06/01/2029	15,311	11,863,943	0.1
Garda World Security Corp.	9.50%	11/01/2027	21,365	19,483,670	0.1
ION Trading Technologies SARL	5.75%	05/15/2028	8,833	7,526,853	0.1
Korn Ferry	4.63%	12/15/2027	17,280	16,004,909	0.1
Millennium Escrow Corp.	6.63%	08/01/2026	30,817	25,159,715	0.2
MoneyGram International, Inc.	5.38%	08/01/2026	12,901	12,677,360	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.50%	09/01/2028	23,935	20,399,917	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028	59,950	47,565,922	0.3
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	5.63%	10/01/2028	10,955	10,998,394	0.1
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	5.88%	10/01/2030	11,761	11,799,392	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026	3,000	2,895,386	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028	51,628	45,672,098	0.3
Q-Park Holding I BV	2.00%	03/01/2027	EUR 467	388,448	0.0
Sabre GLBL, Inc.	7.38%	09/01/2025	USD 17,465	16,553,948	0.1
Sabre GLBL, Inc.	9.25%	04/15/2025	12,443	12,261,882	0.1
TripAdvisor, Inc.	7.00%	07/15/2025	15,163	14,907,149	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Verisure Holding AB	3.88%	07/15/2026	EUR 8,482	\$ 7,620,640	0.1%
Verisure Midholding AB	5.25%	02/15/2029	21,242	17,210,019	0.1
Verscend Escrow Corp.	9.75%	08/15/2026	USD 57,645	58,248,775	0.4
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	5,687	5,485,078	0.0
ZipRecruiter, Inc.	5.00%	01/15/2030	25,440	21,282,769	0.1
				<u>575,902,461</u>	<u>4.0</u>
TECHNOLOGIE					
Ahead DB Holdings LLC	6.63%	05/01/2028	21,260	19,280,235	0.1
Avaya, Inc.	6.13%	09/15/2028	29,517	16,121,173	0.1
Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025	14,476	14,413,988	0.1
Cablevision Lightpath LLC	5.63%	09/15/2028	16,278	13,336,647	0.1
Centurion Bidco SpA	5.88%	09/30/2026	EUR 4,241	3,947,814	0.0
Clarivate Science Holdings Corp.	4.88%	07/01/2029	USD 9,245	7,652,172	0.1
CommScope, Inc.	4.75%	09/01/2029	5,241	4,454,447	0.0
CommScope, Inc.	6.00%	03/01/2026	15,921	15,056,441	0.1
CommScope, Inc.	8.25%	03/01/2027	6,325	5,421,027	0.0
CWT Travel Group, Inc.	8.50%	11/19/2026	21,705	19,793,918	0.1
Dell International LLC/EMC Corp.	5.85%	07/15/2025	9,315	9,644,657	0.1
Entegris Escrow Corp.	5.95%	06/15/2030	14,018	13,304,779	0.1
GoTo Group, Inc.	5.50%	09/01/2027	13,368	9,819,790	0.1
Minerva Merger Sub, Inc.	6.50%	02/15/2030	26,894	22,827,647	0.2
NCR Corp.	5.00%	10/01/2028	3,000	2,824,354	0.0
NCR Corp.	5.75%	09/01/2027	11,568	11,199,594	0.1
NCR Corp.	6.13%	09/01/2029	11,508	11,016,835	0.1
Playtika Holding Corp.	4.25%	03/15/2029	1,000	851,134	0.0
Presidio Holdings, Inc.	4.88%	02/01/2027	11,848	11,079,846	0.1
Presidio Holdings, Inc.	8.25%	02/01/2028	35,003	31,780,286	0.2
Rackspace Technology Global, Inc.	3.50%	02/15/2028	27,230	19,674,848	0.1
Science Applications International Corp.	4.88%	04/01/2028	2,038	1,892,131	0.0
Seagate HDD Cayman	4.09%	06/01/2029	25,862	22,234,247	0.2
Seagate HDD Cayman	4.88%	06/01/2027	11,014	10,463,623	0.1
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	09/01/2025	72,383	55,773,880	0.4
Virtusa Corp.	7.13%	12/15/2028	17,654	13,990,222	0.1
				<u>367,855,735</u>	<u>2.6</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Air Canada	3.88%	08/15/2026	8,507	7,594,615	0.1
Allegiant Travel Co.	7.25%	08/15/2027	9,128	9,072,518	0.1
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.50%	04/20/2026	23,831	22,687,808	0.2
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.75%	04/20/2029	20,260	18,301,118	0.1
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ HawaiianMiles Loyalty Ltd.	5.75%	01/20/2026	13,097	11,958,466	0.1
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	20,443	20,777,413	0.1
United Airlines, Inc.	4.63%	04/15/2029	7,072	6,207,341	0.0
				<u>96,599,279</u>	<u>0.7</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
AerCap Global Aviation Trust	6.50%	06/15/2045	5,371	5,063,954	0.0
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	5.25%	10/15/2026	EUR 19,265	17,214,729	0.1
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	6.13%	10/15/2026	USD 14,925	13,337,865	0.1
Atlantia SpA	1.88%	02/12/2028	EUR 7,906	6,410,394	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.38%	03/01/2029	USD 16,633	14,507,300	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	32,463	30,680,131	0.2
BCP V Modular Services	6.75%	11/30/2029	EUR 31,430	23,631,376	0.2
BCP V Modular Services Finance II PLC	4.75%	11/30/2028	3,816	3,192,447	0.0
Herc Holdings, Inc.	5.50%	07/15/2027	USD 1,171	1,106,596	0.0
Hertz Corp. (The)	4.63%	12/01/2026	5,583	4,788,524	0.0
Hertz Corp. (The)	5.00%	12/01/2029	11,109	8,938,667	0.1
Loxam SAS	2.88%	04/15/2026	EUR 9,496	8,453,466	0.1
Loxam SAS	3.75%	07/15/2026	6,434	5,849,870	0.0
PROG Holdings, Inc.	6.00%	11/15/2029	USD 23,181	19,447,456	0.1
				<u>162,622,775</u>	<u>1.1</u>
				<u>6,379,529,428</u>	<u>44.3</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Ally Financial, Inc., Series C(c)	4.70%	05/15/2028	16,427	12,761,017	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(c)	6.50%	03/05/2025	41,600	38,959,772	0.2
Bank of Ireland	10.00%	12/19/2022	EUR 15,000	15,436,127	0.1
Bread Financial Holdings, Inc.	4.75%	12/15/2024	USD 24,532	21,685,586	0.1
Bread Financial Holdings, Inc.	7.00%	01/15/2026	11,510	10,359,000	0.1
CaixaBank SA(c)	5.88%	10/09/2027	EUR 200	182,981	0.0
Citizens Financial Group, Inc., Series B(c)	6.00%	07/06/2023	USD 8,895	8,183,400	0.1
Credit Suisse Group AG(c)	6.25%	12/18/2024	31,464	28,317,600	0.2
Credit Suisse Group AG(c)	7.50%	07/17/2023	34,938	30,904,015	0.2
Credit Suisse Group AG(c)	7.50%	12/11/2023	10,650	10,110,381	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Credit Suisse Group AG(c)	9.75%	06/23/2027	USD 1,147	\$ 1,159,904	0.0%
Intesa Sanpaolo SpA	5.02%	06/26/2024	206	197,955	0.0
Intesa Sanpaolo SpA	5.71%	01/15/2026	11,463	10,907,143	0.1
Societe Generale SA(c)	8.00%	09/29/2025	44,504	44,748,913	0.3
				<u>233,913,794</u>	<u>1.6</u>
MAKLER					
Advisor Group Holdings, Inc.	10.75%	08/01/2027	27,269	27,297,268	0.2
AG Issuer LLC.	6.25%	03/01/2028	6,220	5,737,118	0.0
AG Ttmt Escrow Issuer LLC	8.63%	09/30/2027	13,835	13,839,666	0.1
Hightower Holding LLC	6.75%	04/15/2029	29,639	24,991,518	0.2
Jane Street Group/JSG Finance, Inc.	4.50%	11/15/2029	17,256	15,664,077	0.1
NFP Corp.	6.88%	08/15/2028	54,445	44,859,098	0.3
NFP Corp.	7.50%	10/01/2030	17,638	17,380,860	0.1
				<u>149,769,605</u>	<u>1.0</u>
FINANZEN					
Aircastle Ltd.(c)	5.25%	06/15/2026	24,017	19,006,292	0.1
Castlelake Aviation Finance DAC	5.00%	04/15/2027	10,157	8,736,088	0.1
CNG Holdings, Inc.	12.50%	06/15/2024	17,033	15,071,310	0.1
Compass Group Diversified Holdings LLC	5.25%	04/15/2029	25,935	22,276,642	0.2
Curo Group Holdings Corp.	7.50%	08/01/2028	49,329	29,926,032	0.2
Enova International, Inc.	8.50%	09/01/2024	6,350	6,103,825	0.0
Enova International, Inc.	8.50%	09/15/2025	32,666	30,463,285	0.2
goeasy Ltd.	5.38%	12/01/2024	14,674	13,858,069	0.1
ILFC E-Capital Trust I(d)	4.85%	12/21/2065	9,500	6,860,640	0.0
Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp.	5.00%	08/15/2028	28,217	24,082,096	0.2
Navient Corp.	4.88%	03/15/2028	7,305	5,994,036	0.0
Navient Corp.	5.00%	03/15/2027	9,095	7,836,504	0.1
Navient Corp.	5.88%	10/25/2024	1,000	964,603	0.0
Navient Corp.	6.75%	06/25/2025	9,594	9,262,432	0.1
Navient Corp.	6.75%	06/15/2026	8,393	7,969,238	0.1
Navient Corp.	7.25%	09/25/2023	182	182,513	0.0
OneMain Finance Corp.	6.88%	03/15/2025	6,000	5,844,312	0.0
Springleaf Finance Corp.	7.13%	03/15/2026	3,000	2,795,204	0.0
				<u>217,233,121</u>	<u>1.5</u>
VERSICHERUNGEN					
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	6.00%	08/01/2029	2,239	1,839,930	0.0
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	7.00%	11/15/2025	25,698	24,267,521	0.2
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	10.13%	08/01/2026	19,929	20,004,807	0.1
AmWINS Group, Inc.	4.88%	06/30/2029	8,871	7,764,809	0.1
Ardonagh Midco 2 PLC(a)	11.50%	01/15/2027	39,296	39,817,058	0.3
AssuredPartners, Inc.	5.63%	01/15/2029	35,614	29,894,965	0.2
HUB International Ltd.	7.00%	05/01/2026	5,000	4,899,701	0.0
USI, Inc./NY	6.88%	05/01/2025	2,000	1,941,426	0.0
				<u>130,430,217</u>	<u>0.9</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
Altice France Holding SA	10.50%	05/15/2027	16,348	14,204,026	0.1
Armor Holdco, Inc.	8.50%	11/15/2029	31,547	26,050,328	0.2
Coinbase Global, Inc.	3.63%	10/01/2031	22,357	13,612,796	0.1
Intrum AB	3.50%	07/15/2026	EUR 16,915	14,918,779	0.1
Intrum AB	4.88%	08/15/2025	10,509	10,063,525	0.1
Motion Finco SARL	7.00%	05/15/2025	1,491	1,492,243	0.0
				<u>80,341,697</u>	<u>0.6</u>
REITs					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	4.50%	04/01/2027	USD 26,418	22,673,549	0.1
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	5.75%	05/15/2026	8,837	8,283,128	0.1
Diversified Healthcare Trust	4.75%	02/15/2028	3,000	2,204,746	0.0
Diversified Healthcare Trust	9.75%	06/15/2025	11,998	11,791,296	0.1
Iron Mountain UK PLC	3.88%	11/15/2025	GBP 1,000	1,054,026	0.0
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2027	USD 1,028	943,296	0.0
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2029	13,788	11,965,375	0.1
Iron Mountain, Inc.	5.00%	07/15/2028	10,641	9,713,746	0.1
Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028	2,653	2,449,823	0.0
Park Intermediate Holdings LLC/ PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer	4.88%	05/15/2029	9,031	7,957,994	0.1
Vivion Investments SARL	3.00%	08/08/2024	EUR 6,500	5,835,780	0.0
Vivion Investments SARL	3.50%	11/01/2025	300	262,707	0.0
				<u>85,135,466</u>	<u>0.6</u>
				<u>896,823,900</u>	<u>6.2</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Calpine Corp.....	4.50%	02/15/2028	USD 1,000	\$ 914,990	0.0%
Calpine Corp.....	4.63%	02/01/2029	1,000	855,436	0.0
Calpine Corp.....	5.00%	02/01/2031	4,000	3,373,365	0.0
Calpine Corp.....	5.13%	03/15/2028	17,753	15,857,702	0.1
Calpine Corp.....	5.25%	06/01/2026	661	642,584	0.0
NRG Energy, Inc.....	6.63%	01/15/2027	334	332,852	0.0
Vistra Corp.(c)	7.00%	12/15/2026	14,856	13,816,080	0.1
Vistra Corp.(c)	8.00%	10/15/2026	17,732	16,978,390	0.1
				<u>52,771,399</u>	<u>0.3</u>
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Solaris Midstream Holdings LLC	7.63%	04/01/2026	8,515	8,214,123	0.1
				<u>60,985,522</u>	<u>0.4</u>
				<u>7,337,338,850</u>	<u>50.9</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
STAATSANLEIHEN					
ANGOLA					
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	44,317	36,672,318	0.2
Angolan Government International Bond	8.25%	05/09/2028	28,770	24,957,975	0.2
Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049	38,181	28,475,867	0.2
Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048	10,509	7,986,840	0.1
				<u>98,093,000</u>	<u>0.7</u>
ARGENTINIEN					
Argentine Republic Government International Bond	0.50%	07/09/2030	52,183	12,367,428	0.1
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	20,068	4,665,698	0.0
Argentine Republic Government International Bond	1.50%	07/09/2035	18,289	4,105,803	0.0
Argentine Republic Government International Bond	3.50%	07/09/2041	30,585	8,013,247	0.1
Argentine Republic Government International Bond	3.88%	01/09/2038	24,411	6,824,342	0.0
				<u>35,976,518</u>	<u>0.2</u>
KOLUMBIEN					
Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	17,589	12,733,337	0.1
Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	9,337	7,445,090	0.0
Colombia Government International Bond	7.38%	09/18/2037	13,795	13,064,727	0.1
				<u>33,243,154</u>	<u>0.2</u>
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028	57,840	55,193,820	0.4
Dominican Republic International Bond	6.50%	02/15/2048	7,709	6,175,873	0.1
Dominican Republic International Bond	7.45%	04/30/2044	17,877	16,282,595	0.1
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	16,359	17,144,232	0.1
				<u>94,796,520</u>	<u>0.7</u>
ECUADOR					
Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	5,863	1,979,736	0.0
Ecuador Government International Bond	1.50%	07/31/2040	16,709	5,710,144	0.1
Ecuador Government International Bond	2.50%	07/31/2035	92,884	35,574,507	0.2
Ecuador Government International Bond	5.50%	07/31/2030	27,255	14,288,305	0.1
				<u>57,552,692</u>	<u>0.4</u>
ÄGYPTEN					
Egypt Government International Bond	3.88%	02/16/2026	5,392	4,192,280	0.0
Egypt Government International Bond	5.88%	02/16/2031	1,655	1,121,573	0.0
Egypt Government International Bond	6.20%	03/01/2024	8,576	7,954,240	0.1
Egypt Government International Bond	7.30%	09/30/2033	3,437	2,311,383	0.0
Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	9,285	7,799,400	0.1
Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	43,364	30,281,623	0.2
Egypt Government International Bond	8.50%	01/31/2047	7,580	4,813,300	0.0
Egypt Government International Bond	8.70%	03/01/2049	10,320	6,527,400	0.1
Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050	22,855	14,627,200	0.1
				<u>79,628,399</u>	<u>0.6</u>
EL SALVADOR					
El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	19,017	10,079,010	0.1
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	8,560	3,219,630	0.0
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	17,148	5,704,925	0.1
El Salvador Government International Bond	7.63%	02/01/2041	7,141	2,386,879	0.0
El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035	1,843	626,390	0.0
El Salvador Government International Bond	9.50%	07/15/2052	15,430	5,630,021	0.0
				<u>27,646,855</u>	<u>0.2</u>
GABUN					
Gabon Government International Bond	6.63%	02/06/2031	28,288	20,982,624	0.2
Gabon Government International Bond	6.95%	06/16/2025	17,720	15,170,535	0.1
				<u>36,153,159</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
GHANA					
Ghana Government International Bond	8.13%	03/26/2032	USD 5,487	\$ 2,071,342	0.0%
Ghana Government International Bond	8.95%	03/26/2051	6,050	2,118,634	0.0
Ghana Government International Bond	10.75%	10/14/2030	1,243	891,853	0.0
				<u>5,081,829</u>	<u>0.0</u>
ELFENBEINKÜSTE					
Ivory Coast Government International Bond	4.88%	01/30/2032	EUR 43,563	32,937,951	0.2
Ivory Coast Government International Bond	5.13%	06/15/2025	3,272	3,070,970	0.0
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	USD 8,905	8,266,623	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.88%	10/17/2040	EUR 39,053	28,166,587	0.2
				<u>72,442,131</u>	<u>0.5</u>
KENIA					
Republic of Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	USD 16,016	12,732,720	0.1
Republic of Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028	9,643	7,473,325	0.0
				<u>20,206,045</u>	<u>0.1</u>
LIBANON					
Lebanon Government International Bond(e)	6.60%	11/27/2026	10,759	748,423	0.0
Lebanon Government International Bond(e)	6.65%	04/22/2024	4,315	305,556	0.0
Lebanon Government International Bond(e)	6.85%	03/23/2027	5,606	386,463	0.0
				<u>1,440,442</u>	<u>0.0</u>
NIGERIA					
Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	12,918	9,287,235	0.1
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	15,679	9,642,585	0.1
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	14,105	8,991,938	0.0
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	24,639	17,678,482	0.1
				<u>45,600,240</u>	<u>0.3</u>
PAKISTAN					
Pakistan Government International Bond	6.00%	04/08/2026	15,032	9,321,494	0.1
Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	918	564,671	0.0
Pakistan Government International Bond	7.38%	04/08/2031	25,092	13,928,820	0.1
				<u>23,814,985</u>	<u>0.2</u>
SENEGAL					
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	53,439	43,028,415	0.3
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	16,224	11,278,722	0.1
				<u>54,307,137</u>	<u>0.4</u>
SÜDAFRIKA					
Republic of South Africa Government International Bond	5.65%	09/27/2047	8,663	6,174,012	0.1
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	103,528	73,375,470	0.5
Republic of South Africa Government International Bond	6.30%	06/22/2048	1,684	1,303,837	0.0
				<u>80,853,319</u>	<u>0.6</u>
UKRAINE					
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2035	17,273	3,022,775	0.0
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2034	24,077	4,273,667	0.0
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2025	45,102	10,824,480	0.1
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2026	38,721	7,841,002	0.1
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2027	10,000	2,000,000	0.0
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2029	13,037	2,639,993	0.0
Ukraine Government International Bond	9.75%	11/01/2030	9,111	1,867,755	0.0
				<u>32,469,672</u>	<u>0.2</u>
VENEZUELA					
Venezuela Government International Bond(e)	9.00%	05/07/2023	4,270	362,950	0.0
Venezuela Government International Bond(e)	9.25%	09/15/2027	57,269	4,867,865	0.0
				<u>5,230,815</u>	<u>0.0</u>
				<u>804,536,912</u>	<u>5.6</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	8,549	6,625,475	0.0
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	24,763	21,342,611	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028	10,931	10,079,475	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	32,575	28,625,281	0.2
Cia de Minas Buenaventura SAA	5.50%	07/23/2026	14,043	12,312,200	0.1
CSN Inova Ventures	6.75%	01/28/2028	14,737	13,916,886	0.1
CSN Resources SA	7.63%	04/17/2026	12,983	13,027,467	0.1
Eldorado Gold Corp.	6.25%	09/01/2029	20,939	16,744,657	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	6.88%	10/15/2027	33,725	32,278,872	0.2
First Quantum Minerals Ltd.	7.50%	04/01/2025	10,621	10,481,599	0.1
GUSAP III LP	4.25%	01/21/2030	7,373	6,859,286	0.0
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	28,102	26,963,869	0.2
JSW Steel Ltd.	3.95%	04/05/2027	4,086	3,411,810	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
JSW Steel Ltd.	5.95%	04/18/2024	USD 9,640	\$ 9,495,400	0.1%
Nexa Resources SA	6.50%	01/18/2028	22,620	22,430,557	0.2
OCP SA	3.75%	06/23/2031	7,803	6,358,470	0.0
Sasol Financing USA LLC.....	5.88%	03/27/2024	9,655	9,621,208	0.1
Stillwater Mining Co.....	4.00%	11/16/2026	10,431	9,191,015	0.1
Stillwater Mining Co.....	4.50%	11/16/2029	9,575	7,808,413	0.1
Vedanta Resources Finance II PLC	13.88%	01/21/2024	40,014	34,562,092	0.2
Volcan Cia Minera SAA.....	4.38%	02/11/2026	2,267	1,963,505	0.0
				<u>304,100,148</u>	<u>2.1</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Cemex SAB de CV	3.88%	07/11/2031	3,953	3,310,143	0.0
Cemex SAB de CV(c)	5.13%	06/08/2026	17,508	14,509,755	0.1
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	10,634	10,740,340	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	26,390	25,421,751	0.2
Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028	23,369	23,256,537	0.2
IHS Holding Ltd.	5.63%	11/29/2026	7,892	6,795,998	0.0
IHS Holding Ltd.	6.25%	11/29/2028	3,321	2,797,943	0.0
				<u>86,832,467</u>	<u>0.6</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	20,343	16,583,359	0.1
VTR Finance NV	6.38%	07/15/2028	2,602	1,143,742	0.0
				<u>17,727,101</u>	<u>0.1</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	25,208	22,276,306	0.2
CT Trust	5.13%	02/03/2032	2,789	2,414,956	0.0
Digicel International Finance Ltd./ Digicel international Holdings Ltd.....	8.75%	05/25/2024	4,359	4,113,261	0.0
HTA Group Ltd./Mauritius	7.00%	12/18/2025	14,504	13,582,089	0.1
MTN Mauritius Investments Ltd.	6.50%	10/13/2026	3,770	3,831,969	0.0
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	14,252	13,175,812	0.1
				<u>59,394,393</u>	<u>0.4</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026	6,109	5,564,154	0.1
BRF SA	4.88%	01/24/2030	5,436	4,587,712	0.0
BRF SA	5.75%	09/21/2050	2,952	2,092,968	0.0
Central American Bottling Corp./CBC Bottling Holdco SL/ Beliv Holdco SL	5.25%	04/27/2029	2,741	2,525,146	0.0
MARB BondCo PLC	3.95%	01/29/2031	29,451	23,216,592	0.2
Natura & Co., Luxembourg Holdings SARL.....	6.00%	04/19/2029	14,844	13,051,587	0.1
Ulker Biskuvi Sanayi AS	6.95%	10/30/2025	5,581	3,956,580	0.0
				<u>54,994,739</u>	<u>0.4</u>
ELEKTRIZITÄT					
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	2,663	2,490,271	0.0
ENERGIE					
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	9,100	7,674,144	0.1
Cosan SA	5.50%	09/20/2029	13,818	13,267,871	0.1
Ecopetrol SA	4.63%	11/02/2031	8,355	6,485,569	0.0
Ecopetrol SA	5.88%	11/02/2051	6,407	4,244,637	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	23,645	21,916,078	0.1
Gran Tierra Energy, Inc.....	7.75%	05/23/2027	9,261	7,651,343	0.1
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.	5.50%	04/06/2025	19,060	17,154,000	0.1
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	3,062	2,889,762	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028	1,661	1,573,521	0.0
Kosmos Energy Ltd.	7.50%	03/01/2028	13,719	11,715,168	0.1
Medco Platinum Road Pte Ltd.	6.75%	01/30/2025	15,289	14,570,417	0.1
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	10,832	9,965,564	0.1
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	3,463	2,960,865	0.0
Peru LNG SRL.....	5.38%	03/22/2030	18,983	16,040,635	0.1
Raizen Fuels Finance SA.....	5.30%	01/20/2027	7,683	7,649,387	0.1
SEPLAT Energy PLC.....	7.75%	04/01/2026	17,384	15,297,920	0.1
SierraCol Energy Andina LLC.....	6.00%	06/15/2028	11,029	8,056,023	0.1
				<u>169,112,904</u>	<u>1.2</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Bidvest Group UK PLC (The)	3.63%	09/23/2026	7,895	7,212,083	0.1
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	304	275,264	0.0
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	36,561	32,722,095	0.2
				<u>32,997,359</u>	<u>0.2</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA	6.75%	03/30/2029	10,660	10,093,688	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
JSW Infrastructure Ltd.	4.95%	01/21/2029	USD 2,678	\$ 2,214,873	0.0%
				<u>12,308,561</u>	<u>0.1</u>
				<u>747,170,026</u>	<u>5.2</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Adani Green Energy Ltd.	4.38%	09/08/2024	8,085	7,195,650	0.0
AES Andes SA.	6.35%	10/07/2079	10,186	9,428,416	0.1
Cemig Geracao e Transmissao SA.	9.25%	12/05/2024	31,570	33,172,177	0.1
India Clean Energy Holdings.	4.50%	04/18/2027	11,748	8,928,480	0.1
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	8,915	7,990,069	0.1
JSW Hydro Energy Ltd.	4.13%	05/18/2031	2,234	1,801,388	0.0
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA.	4.38%	06/18/2026	14,120	12,247,335	0.1
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033	11,929	11,541,453	0.1
				<u>92,304,968</u>	<u>0.6</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Absa Group Ltd.(e)	6.38%	05/27/2026	6,561	6,014,797	0.0
BBVA Bancomer SA/Texas.	5.88%	09/13/2034	3,720	3,407,985	0.0
Fidelity Bank PLC.	10.50%	10/16/2022	11,480	11,417,577	0.1
				<u>20,840,359</u>	<u>0.1</u>
FINANZEN					
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	4.75%	04/27/2027	4,249	3,520,828	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.25%	11/13/2024	2,492	2,204,672	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.75%	05/29/2024	1,330	1,219,693	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	4.50%	05/29/2029	6,073	4,660,268	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.63%	06/03/2026	5,895	5,046,857	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.88%	11/22/2026	2,841	2,416,271	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.50%	01/16/2025	20,581	19,099,168	0.2
				<u>38,167,757</u>	<u>0.3</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
OEC Finance Ltd.(a)	4.38%	10/25/2029	3,270	86,646	0.0
OEC Finance Ltd.(a)	5.25%	12/27/2033	3,754	97,602	0.0
OEC Finance Ltd.(a)	7.13%	12/26/2046	36,081	953,965	0.0
				<u>1,138,213</u>	<u>0.0</u>
REITs					
China Aoyuan Group Ltd.(e)	5.38%	09/13/2022	206	12,875	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(e)	5.88%	03/01/2027	3,953	247,062	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(e)	5.98%	08/18/2025	1,187	72,555	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(e)	7.95%	02/19/2023	1,954	122,491	0.0
China Evergrande Group(e)	12.00%	01/22/2024	905	64,085	0.0
China SCE Group Holdings Ltd.	6.00%	02/04/2026	3,014	576,051	0.0
China SCE Group Holdings Ltd.	7.00%	05/02/2025	2,558	532,064	0.0
CIFI Holdings Group Co., Ltd.	4.80%	05/17/2028	220	98,698	0.0
CIFI Holdings Group Co., Ltd.	5.95%	10/20/2025	392	197,960	0.0
Country Garden Holdings Co., Ltd.	3.13%	10/22/2025	250	122,500	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e)	9.38%	06/30/2024	1,744	193,802	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e)	9.95%	07/23/2025	8,471	941,340	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e)	10.50%	01/15/2025	673	74,451	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e)	11.50%	01/30/2023	3,996	439,560	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e)	11.65%	06/01/2026	1,453	159,648	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e)	11.70%	11/11/2025	552	60,306	0.0
KWG Group Holdings Ltd.	5.95%	08/10/2025	2,831	360,599	0.0
KWG Group Holdings Ltd.	6.00%	08/14/2026	548	67,918	0.0
KWG Group Holdings Ltd.	7.40%	01/13/2027	569	71,125	0.0
Logan Group Co., Ltd.(e)	5.25%	10/19/2025	200	33,000	0.0
Logan Group Co., Ltd.(e)	5.75%	01/14/2025	210	34,650	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	4.90%	05/13/2026	1,277	159,625	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	5.95%	04/30/2025	1,505	175,238	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	6.25%	08/10/2024	738	99,077	0.0
Scenery Journey Ltd.(e)	11.50%	10/24/2022	4,734	213,030	0.0
Seazen Group Ltd.	6.00%	08/12/2024	230	104,621	0.0
Shimao Group Holdings Ltd.(e)	5.20%	01/16/2027	2,374	314,555	0.0
Shimao Group Holdings Ltd.(e)	5.60%	07/15/2026	1,457	196,695	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e)	5.95%	04/26/2024	1,090	152,600	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e)	6.50%	01/10/2025	3,385	473,900	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e)	6.50%	01/26/2026	1,306	182,840	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e)	6.65%	08/03/2024	436	61,040	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e)	6.80%	10/20/2024	1,276	178,640	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e)	7.00%	07/09/2025	338	47,320	0.0
Times China Holdings Ltd.	5.55%	06/04/2024	2,944	515,200	0.0
Times China Holdings Ltd.	5.75%	01/14/2027	2,691	376,740	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Times China Holdings Ltd.	6.20%	03/22/2026	USD 328	\$ 45,920	0.0%
Times China Holdings Ltd.	6.60%	03/02/2023	200	49,000	0.0
Times China Holdings Ltd.	6.75%	07/08/2025	2,003	300,450	0.0
Trust Fibra Uno	6.95%	01/30/2044	3,173	2,729,415	0.1
Yango Justice International Ltd.(e)	7.50%	04/15/2024	1,669	91,795	0.0
Yango Justice International Ltd.(e)	7.50%	02/17/2025	8,149	448,195	0.0
Yango Justice International Ltd.(e)	7.88%	09/04/2024	3,782	208,010	0.0
Yango Justice International Ltd.(e)	8.25%	11/25/2023	1,088	59,840	0.0
Yango Justice International Ltd.(e)	9.25%	04/15/2023	200	11,000	0.0
Zhenro Properties Group Ltd.(e)	7.10%	09/10/2024	1,140	45,600	0.0
				<u>11,723,086</u>	<u>0.1</u>
				<u>71,869,415</u>	<u>0.5</u>
				<u>1,715,881,321</u>	<u>11.9</u>

INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT

FINANZINSTITUTE

BANKWESEN

Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	29,736	32,912,960	0.3
Bank of America Corp., Series AA(c)	6.10%	03/17/2025	14,150	13,977,511	0.1
Bank of America Corp., Series B.	8.05%	06/15/2027	32,004	35,217,326	0.2
Bank of America Corp., Series DD(c)	6.30%	03/10/2026	29,824	30,579,425	0.2
Bank of America Corp., Series X(c)	6.25%	09/05/2024	7,260	7,197,218	0.1
Bank of America Corp., Series Z(c)	6.50%	10/23/2024	808	814,792	0.0
Barclays PLC(c)	7.13%	06/15/2025	GBP 6,422	7,118,359	0.1
Barclays PLC(c)	7.25%	03/15/2023	5,167	5,943,192	0.0
Barclays PLC(c)	8.00%	03/15/2029	USD 24,360	23,748,068	0.2
Barclays PLC(c)	8.88%	09/15/2027	GBP 7,438	8,711,051	0.1
BNP Paribas SA(c)	7.75%	08/16/2029	USD 17,116	17,067,789	0.1
Citigroup, Inc.(c)	3.88%	02/18/2026	8,826	7,665,121	0.1
Citigroup, Inc.(c)	5.95%	01/30/2023	33,515	33,197,964	0.2
Citigroup, Inc., Series T(c)	6.25%	08/15/2026	5,672	5,675,965	0.0
Citigroup, Inc., Series V(c)	4.70%	01/30/2025	8,408	7,119,551	0.1
Citigroup, Inc., Series W(c)	4.00%	12/10/2025	7,221	6,335,745	0.0
Citigroup, Inc., Series Y(c)	4.15%	11/15/2026	14,900	12,622,650	0.1
Commerzbank AG	8.13%	09/19/2023	1,629	1,663,574	0.0
Credit Agricole SA(c)	8.13%	12/23/2025	14,131	14,466,611	0.1
Credit Agricole SA(c)	8.13%	03/23/2171	21,632	22,150,788	0.2
Dresdner Funding Trust I	8.15%	06/30/2031	5,173	5,679,887	0.0
Erste Group Bank AG(c)	6.50%	04/15/2024	EUR 10,600	10,500,977	0.1
First-Citizens Bank & Trust Co.	3.93%	06/19/2024	USD 6,749	6,680,210	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series O(c)	5.30%	11/10/2026	3,702	3,576,533	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(c)	5.00%	11/10/2022	39,485	37,159,024	0.3
HSBC Holdings PLC(c)	4.75%	07/04/2029	EUR 9,250	7,844,170	0.1
HSBC Holdings PLC	4.76%	03/29/2033	USD 15,807	14,164,381	0.1
HSBC Holdings PLC(c)	6.00%	09/29/2023	EUR 6,504	6,538,147	0.0
HSBC Holdings PLC(c)	6.38%	03/30/2025	USD 4,594	4,433,210	0.0
ING Groep NV(c)	6.50%	04/16/2025	24,907	23,665,615	0.2
ING Groep NV(c)	6.75%	04/16/2024	5,795	5,667,575	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series R(c)	6.00%	08/01/2023	15,000	14,701,583	0.1
Lloyds Banking Group PLC	3.37%	12/14/2046	4,061	2,835,399	0.0
Lloyds Banking Group PLC(c)	7.50%	06/27/2024	6,268	6,180,067	0.0
Regions Bank/Birmingham AL	6.45%	06/26/2037	28,048	31,259,798	0.2
Skandinaviska Enskilda Banken AB(c)	6.88%	06/30/2027	600	588,887	0.0
Standard Chartered PLC(c) (f)	4.32%	01/30/2027	16,000	12,799,963	0.1
Standard Chartered PLC(c)	7.75%	04/02/2023	10,925	10,978,315	0.1
UBS Group AG(c)	7.00%	01/31/2024	49,607	48,559,394	0.3
UBS Group AG(c)	7.00%	02/19/2025	32,133	32,310,610	0.2
				<u>580,309,405</u>	<u>4.0</u>

MAKLER

Charles Schwab Corp. (The), Series G(c)	5.38%	06/01/2025	25,247	25,167,470	0.2
---	-------	------------	--------	------------	-----

FINANZEN

AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.30%	01/30/2032	11,358	9,238,957	0.1
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.88%	01/23/2028	6,059	5,524,121	0.1
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	6.50%	07/15/2025	3,386	3,470,046	0.0
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	5,211	4,256,086	0.0
Aircastle Ltd.	4.25%	06/15/2026	648	596,909	0.0
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	42,255	40,706,413	0.3
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	1,558	1,344,773	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	5,788	4,949,820	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	7,715	7,213,644	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	5,387	5,135,695	0.0
				<u>82,436,464</u>	<u>0.6</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSICHERUNGEN					
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	USD 39,949	\$ 40,662,210	0.3%
Aon Corp.	8.21%	01/01/2027	13,915	14,934,554	0.1
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(f)	5.03%	02/12/2047	10,000	8,318,732	0.1
Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059	EUR 1,111	1,015,804	0.0
Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037	USD 33,248	38,426,107	0.3
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	7,000	7,764,160	0.1
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039	16,185	22,068,169	0.1
Nationwide Financial Services, Inc.	6.75%	05/15/2037	3,000	2,969,568	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co.(f)	4.12%	12/15/2024	5,000	4,996,928	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co.	9.38%	08/15/2039	22,662	30,775,638	0.2
Prudential Financial, Inc.	5.63%	06/15/2043	13,127	13,075,770	0.1
Transatlantic Holdings, Inc.	8.00%	11/30/2039	14,148	17,851,208	0.1
				<u>202,858,848</u>	<u>1.4</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	04/03/2026	1,974	1,908,145	0.0
REITs					
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	4.63%	08/01/2029	3,685	3,096,880	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.00%	10/15/2027	2,644	2,389,536	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	4.13%	08/15/2030	3,000	2,635,897	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	4.63%	06/15/2025	4,985	4,825,822	0.1
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	5.63%	05/01/2024	3,667	3,672,280	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	5.75%	02/01/2027	2,493	2,453,906	0.0
				<u>19,074,321</u>	<u>0.1</u>
				<u>911,754,653</u>	<u>6.3</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
ArcelorMittal SA	6.75%	03/01/2041	14,928	14,721,080	0.1
ArcelorMittal SA	7.00%	10/15/2039	11,517	11,771,984	0.1
Arconic Corp.	6.00%	05/15/2025	20,000	19,674,804	0.1
Celanese US Holdings LLC	5.90%	07/05/2024	7,027	7,083,565	0.1
Celanese US Holdings LLC	6.05%	03/15/2025	7,027	7,046,320	0.1
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043	20,942	18,634,048	0.1
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044	14,106	13,214,082	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.40%	11/14/2034	11,724	11,095,976	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.45%	03/15/2043	16,385	14,711,152	0.1
INEOS Finance PLC	2.88%	05/01/2026	EUR 5,759	5,179,819	0.0
INEOS Finance PLC	3.38%	03/31/2026	3,380	3,131,931	0.0
Suzano Austria GmbH, Series DM3N	3.13%	01/15/2032	USD 5,618	4,441,731	0.0
				<u>130,706,492</u>	<u>0.9</u>
INVESTITIONSGÜTER					
General Electric Co., Series D(c) (f)	5.16%	12/15/2022	30,828	29,184,865	0.2
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Directv Financing LLC/Directv Financing Co-Obligor, Inc.	5.88%	08/15/2027	11,976	10,959,247	0.1
Netflix, Inc.	4.88%	06/15/2030	1,000	951,758	0.0
Netflix, Inc.	5.88%	11/15/2028	33,984	34,423,087	0.2
				<u>46,334,092</u>	<u>0.3</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Sprint Capital Corp.	8.75%	03/15/2032	455	549,008	0.0
Sprint Corp.	7.13%	06/15/2024	1,000	1,034,453	0.0
Sprint Corp.	7.63%	02/15/2025	3,000	3,138,152	0.0
Sprint Corp.	7.63%	03/01/2026	8,328	8,824,146	0.1
Sprint Corp.	7.88%	09/15/2023	25,000	25,763,295	0.2
				<u>39,309,054</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
General Motors Co.	6.25%	10/02/2043	2,398	2,291,784	0.0
General Motors Co.	6.80%	10/01/2027	3,641	3,863,799	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.65%	01/17/2029	11,876	11,825,922	0.1
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030	12,304	10,702,962	0.1
				<u>28,684,467</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	31,126	25,524,100	0.2
Owens Corning	7.00%	12/01/2036	2,898	3,131,561	0.0
PulteGroup, Inc.	6.00%	02/15/2035	615	598,383	0.0
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	24,025	24,371,517	0.2
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	16,167	18,030,784	0.1
Sands China Ltd.	3.75%	08/08/2031	1,319	963,423	0.0
Sands China Ltd.	4.88%	06/18/2030	4,444	3,544,090	0.0
Sands China Ltd.	5.90%	08/08/2028	2,596	2,200,110	0.0
				<u>78,363,968</u>	<u>0.5</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Macy's Retail Holdings LLC	5.88%	04/01/2029	USD 5,218	\$ 4,514,409	0.0%
Macy's Retail Holdings LLC	5.88%	03/15/2030	8,853	7,567,314	0.1
Macy's Retail Holdings LLC	6.13%	03/15/2032	3,944	3,317,840	0.0
				<u>15,399,563</u>	<u>0.1</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Charles River Laboratories International, Inc.	3.75%	03/15/2029	1,000	863,238	0.0
Pilgrim's Pride Corp.	5.88%	09/30/2027	13,518	13,313,791	0.1
				<u>14,177,029</u>	<u>0.1</u>
ENERGIE					
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	5,144	5,602,151	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	19,163	18,316,332	0.1
Energy Transfer LP	6.25%	04/15/2049	1,000	981,419	0.0
Energy Transfer LP	8.25%	11/15/2029	8,521	9,755,965	0.1
EQT Corp.	3.90%	10/01/2027	10,000	9,476,470	0.1
Hess Corp.	7.30%	08/15/2031	2,953	3,297,416	0.0
Kinder Morgan, Inc.	7.75%	01/15/2032	4,518	5,242,444	0.0
Kinder Morgan, Inc.	7.80%	08/01/2031	18,933	21,811,711	0.2
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	6,690	6,520,283	0.1
Western Midstream Operating LP	3.35%	02/01/2025	12,908	12,209,679	0.1
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	3,902	3,733,709	0.0
Western Midstream Operating LP	4.50%	03/01/2028	13,423	12,474,586	0.1
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	3,831	3,610,836	0.0
Western Midstream Operating LP	5.45%	04/01/2044	5,469	4,801,559	0.0
				<u>117,834,560</u>	<u>0.8</u>
TECHNOLOGIE					
Dell International LLC/EMC Corp.	8.35%	07/15/2046	2,305	2,803,178	0.1
Nokia Oyj.	6.63%	05/15/2039	2,000	2,028,226	0.0
Western Digital Corp.	3.10%	02/01/2032	3,434	2,588,610	0.0
				<u>7,420,014</u>	<u>0.1</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	17,879	17,117,354	0.1
Mileage Plus Holdings LLC/ Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	48,950	49,096,671	0.4
				<u>66,214,025</u>	<u>0.5</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Ashtead Capital, Inc.	5.50%	08/11/2032	3,999	3,929,926	0.0
				<u>577,558,055</u>	<u>4.0</u>
				<u>1,489,312,708</u>	<u>10.3</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds(g)	6.75%	08/15/2026	212,755	238,950,459	1.7
U.S. Treasury Notes	0.63%	08/15/2030	200	164,563	0.0
U.S. Treasury Notes(g)	1.88%	02/15/2032	115,998	104,017,856	0.7
U.S. Treasury Notes	2.88%	08/31/2027	284,825	282,732,806	2.0
U.S. Treasury Notes(g)	2.88%	05/15/2032	268,269	262,232,850	1.8
U.S. Treasury Notes	3.00%	08/15/2052	121,586	115,677,389	0.8
U.S. Treasury Notes	3.13%	08/31/2029	216,909	215,315,766	1.5
				<u>1,219,091,689</u>	<u>8.5</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-1A, Class B1(f)	6.69%	04/25/2028	3,894	3,871,062	0.0
Series 2018-3A, Class M2(f)	5.19%	10/25/2028	14,474	14,207,766	0.1
Series 2019-4A, Class M2(f)	5.29%	10/25/2029	9,310	8,947,167	0.1
Connecticut Avenue Securities Trust, Series 2018-R07, Class 1B1(f)	6.79%	04/25/2031	8,645	8,607,254	0.1
Eagle RE Ltd.					
Series 2019-1, Class M1B(f)	4.24%	04/25/2029	894	890,711	0.0
Series 2019-1, Class M2(f)	5.74%	04/25/2029	3,654	3,615,940	0.0
Series 2020-1, Class M2(f)	4.44%	01/25/2030	10,952	10,278,889	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019-DNA1, Class B1(f)	7.09%	01/25/2049	3,365	3,482,816	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2015-DN1, Class B(f)	13.94%	01/25/2025	1,174	1,188,398	0.0
Series 2015-DNA1, Class B(f)	11.64%	10/25/2027	32,016	32,767,899	0.2
Series 2015-DNA2, Class B(f)	9.99%	12/25/2027	47,611	48,918,083	0.3
Series 2015-DNA3, Class B(f)	11.79%	04/25/2028	15,257	16,208,894	0.1
Series 2015-HQ1, Class B(f)	13.19%	03/25/2025	5,850	5,850,772	0.0
Series 2015-HQ2, Class B(f)	10.39%	05/25/2025	1,419	1,442,363	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2015-HQA1, Class B(f)	11.24%	03/25/2028	USD 19,274	\$ 19,455,991	0.1%
Series 2015-HQA2, Class B(f)	12.94%	05/25/2028	10,427	10,978,269	0.1
Series 2016-DNA3, Class B(f)	13.69%	12/25/2028	7,227	7,853,110	0.1
Series 2016-DNA4, Class B(f)	11.04%	03/25/2029	8,693	8,684,451	0.1
Series 2016-HQA1, Class B(f)	15.19%	09/25/2028	16,412	17,884,284	0.1
Series 2016-HQA2, Class B(f)	13.94%	11/25/2028	13,626	15,013,269	0.1
Series 2016-HQA4, Class B(f)	11.19%	04/25/2029	2,290	2,306,792	0.0
Series 2017-DNA2, Class B1(f)	7.59%	10/25/2029	24,511	26,146,027	0.2
Series 2017-DNA3, Class B1(f)	6.89%	03/25/2030	33,677	35,066,464	0.2
Series 2017-HQA2, Class B1(f)	7.19%	12/25/2029	9,130	9,420,526	0.1
Series 2017-HQA3, Class B1(f)	6.89%	04/25/2030	4,415	4,546,059	0.0
Series 2018-DNA2, Class B1(f)	6.14%	12/25/2030	5,829	5,786,415	0.0
Series 2019-FTR2, Class M2(f)	4.59%	11/25/2048	6,650	6,434,911	0.0
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities, Series 2016-C05, Class 2B(f)	11.24%	01/25/2029	36,061	38,845,670	0.3
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2016-C01, Class 1B(f)	14.19%	08/25/2028	39,161	43,311,889	0.3
Series 2016-C02, Class 1B(f)	14.69%	09/25/2028	21,436	24,075,911	0.2
Series 2016-C03, Class 1B(f)	14.19%	10/25/2028	7,786	8,617,800	0.1
Series 2016-C03, Class 2B(f)	15.19%	10/25/2028	18,453	20,983,545	0.1
Series 2016-C04, Class 1B(f)	12.69%	01/25/2029	46,126	49,542,673	0.3
Series 2016-C06, Class 1B(f)	11.69%	04/25/2029	21,188	22,110,236	0.2
Series 2016-C07, Class 2B(f)	11.94%	05/25/2029	27,677	28,927,251	0.2
Series 2017-C03, Class 1B1(f)	7.29%	10/25/2029	14,858	15,684,773	0.1
Series 2017-C06, Class 1B1(f)	6.59%	02/25/2030	8,320	8,569,176	0.1
Series 2018-C01, Class 1B1(f)	5.99%	07/25/2030	24,895	25,263,209	0.2
Home Re Ltd., Series 2018-1, Class M2(f)	5.44%	10/25/2028	14,423	14,314,661	0.1
Oaktown Re III Ltd., Series 2019-1A, Class M2(f)	4.99%	07/25/2029	2,222	2,207,639	0.0
Radnor RE Ltd.					
Series 2019-1, Class M2(f)	5.64%	02/25/2029	2,254	2,183,948	0.0
Series 2019-2, Class M1B(f)	4.19%	06/25/2029	143	142,769	0.0
Series 2020-1, Class M2A(f)	4.44%	01/25/2030	11,179	10,480,155	0.1
Radnor Re Ltd., Series 2020-1, Class M2B(f)	4.69%	01/25/2030	9,514	8,895,644	0.1
				<u>654,011,531</u>	<u>4.5</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4398, Class IO(h)	6.00%	10/15/2037	20,379	3,903,492	0.1
Series 4976, Class MI(h)	4.50%	05/25/2050	23,637	4,891,334	0.1
Series 4981, Class MI(h)	5.00%	06/25/2050	35,949	7,468,421	0.1
Series 5011, Class MI(h)	3.00%	09/25/2050	10,672	1,728,874	0.0
Series 5015, Class BI(h)	4.00%	09/25/2050	18,048	3,434,286	0.0
Series 5018, Class AI(h)	4.00%	10/25/2050	9,811	1,843,901	0.0
Series 5024, Class DI(h)	4.00%	10/25/2050	4,435	782,906	0.0
Series 5030, Class EI(h)	3.50%	10/25/2050	4,087	682,350	0.0
Series 5040, Class AI(h)	3.50%	11/25/2050	1,570	264,882	0.0
Series 5043, Class IO(h)	5.00%	11/25/2050	11,305	2,460,246	0.0
Series 5052, Class IK(h)	4.00%	12/25/2050	16,461	2,997,720	0.0
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2010-109, Class IQ(h)	5.50%	08/25/2040	3,774	438,755	0.0
Series 2016-26, Class IO(h)	5.00%	05/25/2046	11,319	1,903,807	0.0
Series 2020-76, Class GI(h)	4.00%	11/25/2050	11,671	2,084,364	0.0
Series 2020-89, Class KI(h)	4.00%	12/25/2050	55,456	10,384,561	0.1
Series 2020-96, Class KI(h)	2.50%	01/25/2051	5,726	749,204	0.0
Series 2021-18, Class IT(h)	3.00%	04/25/2051	10,971	1,766,017	0.0
Government National Mortgage Association,					
Series 2021-41, Class UI(h)	3.50%	03/20/2051	22,284	3,802,810	0.0
				<u>51,587,930</u>	<u>0.4</u>
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Alternative Loan Trust					
Series 2006-24CB, Class A16	5.75%	08/25/2036	1,379	860,195	0.0
Series 2006-26CB, Class A6	6.25%	09/25/2036	665	390,875	0.0
Series 2006-26CB, Class A8	6.25%	09/25/2036	2,515	1,478,978	0.0
Series 2006-28CB, Class A14	6.25%	10/25/2036	2,284	1,383,368	0.0
Series 2006-28CB, Class A18	6.00%	10/25/2036	805	473,479	0.0
Series 2006-42, Class 1A6	6.00%	01/25/2047	2,554	1,671,869	0.0
Series 2007-15CB, Class A19	5.75%	07/25/2037	1,394	955,406	0.0
Series 2007-16CB, Class 1A7	6.00%	08/25/2037	2,933	2,405,031	0.0
Bear Stearns ARM Trust, Series 2007-4, Class 22A1	3.71%	06/25/2047	5,259	4,894,666	0.1
ChaseFlex Trust, Series 2007-1, Class 1A3	6.50%	02/25/2037	4,268	1,765,870	0.0
CHL Mortgage Pass-Through Trust					
Series 2006-13, Class 1A19	6.25%	09/25/2036	571	288,060	0.0
Series 2007-3, Class A30	5.75%	04/25/2037	1,146	639,580	0.0
Citigroup Mortgage Loan Trust, Series 2007-AR4, Class 1A1A	3.33%	03/25/2037	991	888,693	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
CitiMortgage Alternative Loan Trust, Series 2007-A3, Class 1A4	5.75%	03/25/2037	USD 461	\$ 412,764	0.0%
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust, Series 2006-AA3, Class A1	3.15%	06/25/2036	1,427	1,198,506	0.0
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, Series 2007-6XS, Class 2A5S	6.00%	02/25/2047	3,815	1,645,522	0.0
Residential Accredit Loans, Inc. Trust Series 2005-QA10, Class A31	4.09%	09/25/2035	3,540	2,603,664	0.1
Series 2005-QS14, Class 3A1	6.00%	09/25/2035	841	758,852	0.0
Residential Asset Securitization Trust Series 2006-A8, Class 3A4	6.00%	08/25/2036	2,265	1,262,543	0.0
Series 2007-A5, Class 2A3	6.00%	05/25/2037	1,017	656,156	0.0
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust, Series 2006-3, Class 3CB4	6.00%	04/25/2036	428	377,842	0.0
				<u>27,011,919</u>	<u>0.2</u>
VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4125, Class SA(f) (i)	3.76%	11/15/2042	5,213	644,655	0.0
Series 4248, Class SL(f) (i)	3.66%	05/15/2041	15,437	1,439,357	0.0
Series 4774, Class BS(f) (i)	3.81%	02/15/2048	20,394	2,787,550	0.0
Series 4954, Class SL(f) (i)	3.61%	02/25/2050	17,056	1,974,920	0.0
Series 4981, Class HS(f) (i)	3.66%	06/25/2050	52,416	6,114,736	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2012-70, Class HS(f) (i)	3.56%	07/25/2042	3,135	385,067	0.0
Series 2013-15, Class SA(f) (i)	3.71%	03/25/2043	13,528	1,747,890	0.0
Series 2015-26, Class SH(f) (i)	4.01%	05/25/2045	4,428	663,165	0.0
Series 2016-89, Class SH(f) (i)	3.56%	12/25/2046	11,510	1,427,051	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2009-76, Class SB(f) (i)	3.71%	09/16/2039	5,508	522,360	0.0
Series 2015-3, Class DS(f) (i)	3.23%	11/20/2041	12,462	410,526	0.0
				<u>18,117,277</u>	<u>0.1</u>
NICHT STAATLICH VARIABLE VERZINSLICH					
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust,					
Series 2007-13, Class A7(f)	3.04%	08/25/2037	2,084	890,787	0.0
Impac Secured Assets Corp., Series 2005-2, Class A2D(f)	3.30%	03/25/2036	1,216	1,040,090	0.0
Lehman XS Trust, Series 2007-16N, Class 2A2(f)	4.14%	09/25/2047	1,727	1,575,334	0.0
PHH Alternative Mortgage Trust, Series 2007-2, Class 1A3(f)	3.10%	05/25/2037	953	900,826	0.0
Residential Accredit Loans, Inc. Trust, Series 2006-QS18, Class 2A2(f) (i)	4.11%	12/25/2036	5,815	688,059	0.0
				<u>5,095,096</u>	<u>0.0</u>
				<u>755,823,753</u>	<u>5.2</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT			2,071,259	169,967,540	1.2
AB SICAV I - Emerging Market Corporate Debt Portfolio - Class S			4,017,647	95,459,291	0.7
AB SICAV I - Emerging Market Local Currency Debt Portfolio - Class ZT			4,688,497	42,477,785	0.3
AB SICAV I - Sustainable Euro High Yield Portfolio - Class S			5,216,996	148,109,668	1.0
AB SICAV I - Financial Credit Portfolio - Class ZT			1,327,996	129,333,522	0.9
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT			4,591,167	58,858,765	0.4
				<u>644,206,571</u>	<u>4.5</u>
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
BAHRAIN					
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.50%	10/25/2027	USD 4,456	4,533,980	0.0
INDONESIEN					
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	4.75%	05/15/2025	1,131	1,135,128	0.0
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030	1,209	1,181,314	0.0
				<u>2,316,442</u>	<u>0.0</u>
MEXIKO					
Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	11,450	8,954,616	0.1
Comision Federal de Electricidad	3.88%	07/26/2033	9,050	6,973,025	0.1
Comision Federal de Electricidad	4.69%	05/15/2029	11,134	9,998,332	0.1
Comision Federal de Electricidad	6.13%	06/16/2045	4,500	3,785,063	0.0
Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031	62,572	46,819,499	0.3
Petroleos Mexicanos	6.70%	02/16/2032	19,401	15,030,925	0.1
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	45,907	28,825,005	0.2
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	23,631	14,710,297	0.1
				<u>135,096,762</u>	<u>1.0</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
PANAMA					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA.....	4.00%	08/11/2041	USD 3,367	\$ 2,737,371	0.0%
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA.....	5.13%	08/11/2061	2,883	2,313,247	0.0
				<u>5,050,618</u>	<u>0.0</u>
SÜDAFRIKA					
Eskom Holdings SOC Ltd.	7.13%	02/11/2025	7,482	<u>7,018,116</u>	<u>0.1</u>
TRINIDAD & TOBAGO					
Trinidad Generation UnLtd.....	5.25%	11/04/2027	217	<u>210,327</u>	<u>0.0</u>
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE					
DP World Crescent Ltd.....	3.88%	07/18/2029	899	863,040	0.0
DP World Ltd/United Arab Emirates.....	5.63%	09/25/2048	3,782	3,707,069	0.0
DP World Salaam(c).....	6.00%	10/01/2025	21,915	<u>21,757,486</u>	<u>0.2</u>
				<u>26,327,595</u>	<u>0.2</u>
VENEZUELA					
Petroleos de Venezuela SA(e)	5.38%	04/12/2027	61,738	<u>2,068,216</u>	<u>0.0</u>
				<u>182,622,056</u>	<u>1.3</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Consolidated Energy Finance SA	5.00%	10/15/2028	EUR 6,188	5,002,390	0.0
Consolidated Energy Finance SA	6.50%	05/15/2026	USD 5,585	<u>5,103,783</u>	<u>0.1</u>
				<u>10,106,173</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Allwyn International AS	3.88%	02/15/2027	EUR 5,118	4,526,134	0.0
Melco Resorts Finance Ltd.....	5.38%	12/04/2029	USD 5,214	3,363,030	0.0
Melco Resorts Finance Ltd.....	5.63%	07/17/2027	10,154	7,204,898	0.1
MGM China Holdings Ltd.....	5.25%	06/18/2025	5,982	5,022,263	0.0
MGM China Holdings Ltd.....	5.38%	05/15/2024	8,461	7,445,680	0.1
MGM China Holdings Ltd.....	5.88%	05/15/2026	6,242	5,180,860	0.0
Studio City Co., Ltd.	7.00%	02/15/2027	3,664	3,041,120	0.0
Studio City Finance Ltd.	5.00%	01/15/2029	2,548	1,324,960	0.0
Studio City Finance Ltd.	6.00%	07/15/2025	9,535	6,150,075	0.0
Wynn Macau Ltd.....	4.88%	10/01/2024	1,000	800,000	0.0
Wynn Macau Ltd.....	5.13%	12/15/2029	3,667	2,550,285	0.0
Wynn Macau Ltd.....	5.50%	01/15/2026	16,527	12,808,425	0.1
Wynn Macau Ltd.....	5.50%	10/01/2027	12,252	<u>8,821,440</u>	<u>0.1</u>
				<u>68,239,170</u>	<u>0.4</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV.....	4.75%	05/09/2027	20,440	17,907,995	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV.....	5.13%	05/09/2029	20,440	17,754,695	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV.....	7.13%	01/31/2025	21,515	<u>21,299,850</u>	<u>0.2</u>
				<u>56,962,540</u>	<u>0.4</u>
ENERGIE					
Leviathan Bond Ltd.	5.75%	06/30/2023	7,973	7,924,663	0.1
Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025	7,639	7,497,482	0.0
Leviathan Bond Ltd.	6.50%	06/30/2027	13,968	<u>13,590,911</u>	<u>0.1</u>
				<u>29,013,056</u>	<u>0.2</u>
				<u>164,320,939</u>	<u>1.1</u>
FINANZINSTITUTE					
VERSICHERUNGEN					
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd./ Highlands Holdings Bond Co-Issuer, Inc.(a)	7.63%	10/15/2025	7,602	<u>7,146,325</u>	<u>0.1</u>
REITs					
Shimao Group Holdings Ltd.(e)	5.20%	01/30/2025	1,488	<u>200,880</u>	<u>0.0</u>
				<u>7,347,205</u>	<u>0.1</u>
				<u>171,668,144</u>	<u>1.2</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E.....	4.80%	02/10/2036	11,700	10,368,668	0.1
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(h)	1.17%	11/15/2050	5,016	171,158	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C8, Class XA(h)	1.65%	06/15/2050	7,770	414,489	0.0
Citigroup Commercial Mortgage Trust Series 2013-GC11, Class XA(h)	1.26%	04/10/2046	22,399	91,457	0.0
Series 2014-GC23, Class D.	4.63%	07/10/2047	15,574	14,387,384	0.1
Series 2015-GC29, Class XA(h)	1.16%	04/10/2048	27,970	592,461	0.0
Series 2017-P8, Class XA(h).....	1.02%	09/15/2050	46,341	1,587,436	0.0
Series 2018-C6, Class XA(h)	0.94%	11/10/2051	3,163	118,321	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Commercial Mortgage Trust					
Series 2010-C1, Class F	4.00%	07/10/2046	USD 3,049	\$ 2,606,871	0.0%
Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	4,120	2,276,712	0.0
Series 2012-CR3, Class XA(h)	1.89%	10/15/2045	20,958	210	0.0
Series 2012-CR5, Class XA(h)	1.54%	12/10/2045	33,670	1,391	0.0
Series 2013-LC6, Class XA(h)	1.38%	01/10/2046	28,266	8,124	0.0
Series 2014-CR16, Class D	5.08%	04/10/2047	20,000	18,325,602	0.2
Series 2014-CR20, Class XA(h)	1.13%	11/10/2047	45,369	696,830	0.0
Series 2016-DC2, Class XA(h)	1.10%	02/10/2049	34,380	861,376	0.0
Series 2017-COR2, Class XA(h)	1.31%	09/10/2050	17,747	800,810	0.0
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044	2,801	1,193,297	0.0
Series 2014-GC18, Class D	5.23%	01/10/2047	2,764	1,140,006	0.0
Series 2017-GS7, Class XA(h)	1.24%	08/10/2050	55,569	2,159,684	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2013-C14, Class D	4.70%	08/15/2046	3,001	1,766,211	0.0
Series 2013-C15, Class XA(h)	1.18%	11/15/2045	28,513	208,064	0.0
Series 2014-C21, Class XA(h)	1.10%	08/15/2047	54,303	666,385	0.0
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2012-LC9, Class G	4.49%	12/15/2047	13,837	10,154,925	0.1
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust					
Series 2012-C6, Class XA(h)	1.57%	11/15/2045	10,488	105	0.0
Series 2015-C22, Class XA(h)	1.15%	04/15/2048	64,855	1,181,962	0.0
Series 2016-C30, Class XA(h)	1.49%	09/15/2049	57,619	2,363,118	0.0
Morgan Stanley Capital I Trust,					
Series 2016-BNK2, Class XA(h)	1.09%	11/15/2049	75,874	2,336,962	0.0
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2017-C2, Class XA(h)	1.13%	08/15/2050	2,468	100,042	0.0
Series 2018-C10, Class XA(h)	1.04%	05/15/2051	81,045	3,249,130	0.0
Series 2018-C14, Class XA(h)	1.15%	12/15/2051	48,062	2,230,929	0.0
Series 2018-C15, Class XA(h)	1.15%	12/15/2051	82,564	3,901,600	0.1
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust					
Series 2016-C33, Class XA(h)	1.75%	03/15/2059	56,244	2,492,891	0.0
Series 2016-C35, Class XA(h)	2.04%	07/15/2048	4,911	268,321	0.0
Series 2016-LC24, Class XA(h)	1.75%	10/15/2049	81,573	4,103,891	0.1
Series 2017-C38, Class XA(h)	1.12%	07/15/2050	24,287	888,221	0.0
Series 2018-C48, Class XA(h)	1.12%	01/15/2052	29,191	1,326,252	0.0
WF-RBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C10, Class XA(h)	1.59%	12/15/2045	65,782	658	0.0
Series 2012-C8, Class F	4.85%	08/15/2045	1,563	1,519,446	0.0
Series 2013-C11, Class XA(h)	1.24%	03/15/2045	59,677	56,031	0.0
				<u>96,617,431</u>	<u>0.7</u>
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class E(f)	7.39%	05/15/2036	5,780	4,523,671	0.0
				<u>101,141,102</u>	<u>0.7</u>
STAMMAKTIE					
Avaya Holdings Corp.			377,239	599,810	0.0
Berry Corp.			1,466,645	13,419,802	0.1
Chord Energy Corp.			119,956	16,979,772	0.1
Civitas Resources, Inc.			90,161	6,057,918	0.0
Denbury, Inc.			143,002	12,717,168	0.1
Diamond Offshore Drilling, Inc.			301,325	2,142,421	0.0
iHeartMedia, Inc. - Class A			542,779	4,803,594	0.0
Intelsat SA			359,729	9,892,547	0.1
SandRidge Energy, Inc.			3,888	81,570	0.0
WillScot Mobile Mini Holdings Corp.			323,192	12,972,927	0.1
				<u>79,667,529</u>	<u>0.5</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class E(f)	8.51%	04/15/2034	USD 5,000	4,445,020	0.0
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class E(f)	8.87%	04/15/2034	4,063	3,641,710	0.0
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class E(f)	8.86%	07/20/2034	2,500	2,216,242	0.0
AGL CLO 13 Ltd., Series 2021-13A, Class E(f)	9.21%	10/20/2034	12,156	10,883,414	0.1
AIG CLO Ltd., Series 2021-3A, Class E(f)	9.24%	01/25/2035	7,600	6,852,996	0.1
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class E(f)	8.46%	04/20/2034	3,000	2,717,166	0.0
Ballyrock CLO Ltd., Series 2021-17A, Class D(f)	8.69%	10/20/2034	5,030	4,427,969	0.0
Ballyrock CLO Ltd., Series 2020-14A, Class D(f)	9.71%	01/20/2034	1,750	1,579,218	0.0
Cedar Funding IX CLO Ltd., Series 2018-9A, Class E(f)	8.06%	04/20/2031	550	482,723	0.0
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(f)	9.04%	07/18/2030	3,732	3,371,233	0.0
Dryden 57 CLO Ltd., Series 2018-57A, Class E(f)	8.11%	05/15/2031	6,004	5,321,916	0.1
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(f)	8.97%	04/15/2034	3,600	3,238,160	0.0
Jamestown CLO XI Ltd., Series 2018-11A, Class D(f)	8.50%	07/14/2031	1,250	1,077,418	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-42A, Class E(f)	8.69%	07/16/2035	2,750	2,484,883	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-44A, Class E(f)	8.74%	10/16/2034	USD 750	\$ 675,802	0.0%
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2019-33A, Class ER(f)	8.99%	10/16/2033	8,200	7,431,635	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2020-39A, Class E(f)	9.91%	01/20/2032	2,250	2,080,067	0.0
OZLM XXII Ltd., Series 2018-22A, Class D(f)	8.04%	01/17/2031	2,933	2,304,000	0.0
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(f)	8.71%	10/20/2034	3,700	3,354,350	0.0
PPM CLO 5 Ltd., Series 2021-5A, Class E(f)	9.24%	10/18/2034	2,050	1,733,326	0.0
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(f)	8.46%	07/15/2031	7,200	5,659,078	0.1
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(f)	9.07%	07/20/2034	2,000	1,791,240	0.0
				<u>77,769,566</u>	<u>0.5</u>
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
BAHRAIN					
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	2,327	1,984,931	0.0
Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031	6,000	5,234,250	0.0
Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029	6,000	5,879,250	0.0
Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030	6,009	6,030,783	0.1
				<u>19,129,214</u>	<u>0.1</u>
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
Dominican Republic International Bond	5.50%	02/22/2029	5,560	5,058,905	0.0
				<u>5,058,905</u>	<u>0.0</u>
OMAN					
Oman Government International Bond	4.13%	01/17/2023	7,000	6,973,750	0.1
Oman Government International Bond	4.75%	06/15/2026	7,017	6,806,490	0.1
Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	16,311	16,433,332	0.1
Oman Government International Bond	7.00%	01/25/2051	4,424	4,081,140	0.0
				<u>34,294,712</u>	<u>0.3</u>
				<u>58,482,831</u>	<u>0.4</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
HONGKONG					
Melco Resorts Finance Ltd.	5.75%	07/21/2028	2,757	1,854,082	0.0
MACAU					
Studio City Finance Ltd.	6.50%	01/15/2028	10,680	5,994,150	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	10,091	7,063,700	0.1
				<u>13,057,850</u>	<u>0.1</u>
MEXIKO					
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	23,933	20,552,464	0.2
VEREINIGTES KÖNIGREICH					
Standard Chartered PLC (c)	7.75%	08/15/2022	3,534	3,436,056	0.0
				<u>38,900,452</u>	<u>0.3</u>
VORZUGSAKTIE					
INDUSTRIE					
ENERGIE					
Gulfport Energy Corp.(a) (c)	10.00%		2,647	17,734,900	0.1
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Vistra Energy Corp.(c)	0.00%		454,387	575,708	0.0
				<u>18,310,608</u>	<u>0.1</u>
SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
HDFC Bank Ltd.	8.10%	03/22/2025	INR 1,070,000	13,142,178	0.1
OPTIONSSCHEINE					
Avaya Holdings Corp., expiring 12/15/2022			750,462	15,009	0.0
				<u>13,903,374,367</u>	<u>96.4</u>
GELDMARKTINSTRUMENTE					
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
FINANZINSTITUTE					
REITs					
Yango Justice International Ltd.(e)	10.25%	09/15/2022	USD 628	35,639	0.0
				<u>13,903,410,006</u>	<u>96.4</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
AG Tracker (j)			1,148,905	1	0.0
ATD New Holdings, Inc.			525,684	36,797,880	0.3

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Battalion Oil Corp.			393	\$ 5,203	0.0%
BIS Industries Holdings Ltd. (j)			10,224,003	10	0.0
Carlson Travel, Inc.			542,258	6,507,096	0.1
CHC Group LLC			262,557	53	0.0
Diamond Offshore Drilling, Inc.			526,435	3,742,953	0.0
Exide Corp. (j)			6,006	1,801,800	0.0
GOLO Mobile, Inc. (j)			485,119	0	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA (j)			75,344	0	0.0
K201640219 South Africa Ltd. A Shares (j)			193,371,375	193	0.0
K201640219 South Africa Ltd. B Shares (j)			30,622,211	31	0.0
Mallinckrodt PLC (j)			80,262	910,974	0.0
Monitronics International, Inc.			407,250	207,697	0.0
Mt Logan Re Ltd.			10,454	10,453,970	0.0
Neenah Enterprises, Inc. (j)			504,400	1	0.0
New Cotai LLC/New Cotai Capital Corp. (j)			63	0	0.0
Paysafe Ltd.			1,617,484	2,668,849	0.0
Southeastern Grocers, Inc. (j)			2,258,161	51,937,703	0.4
Vantage Drilling International			266,094	4,656,645	0.0
				<u>119,691,059</u>	<u>0.8</u>

DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN

NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS

Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-CR3, Class F	4.75%	10/15/2045	USD 3,626	571,101	0.0
Series 2014-CR15, Class XA(h)	0.77%	02/10/2047	40,701	292,679	0.0
Grantor Trust CGCMT, Series 2015-P1X(j)	4.49%	09/15/2048	555	18,777,673	0.2
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(j)	0.00%	10/03/2047	469	6,468,599	0.0
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(j)	4.00%	04/15/2050	1,006	12,478,595	0.1
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(j)	4.00%	11/15/2047	1,109	4,810,546	0.0
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(j)	3.40%	10/15/2057	581	12,935,452	0.1
GS Mortgage Securities Trust					
Series GT-E1(j)	3.49%	10/07/2046	155	4,267,881	0.0
Series GT-E2(d)(j)	3.49%	10/07/2046	164	6,383,318	0.1
Series GT-F3(j)	3.49%	10/07/2046	69	1,242,706	0.0
Series GT-F4(d)(j)	3.49%	10/07/2046	41	2,318,260	0.0
Series GT-G1(d)(j)	3.49%	10/07/2046	636	5,978,821	0.1
Series GT-G2(j)	3.49%	10/07/2046	386	3,665,103	0.0
WF-RBS Commercial Mortgage Trust,					
Series 2014-C20, Class D	3.99%	05/15/2047	4,799	1,823,586	0.0
				<u>82,014,320</u>	<u>0.6</u>

BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN

FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE

Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4987, Class IC(h)	4.50%	06/25/2050	80,795	13,881,343	0.1
Series 4993, Class LI(h)	5.00%	07/25/2050	9,782	1,575,632	0.0
Series 5008, Class AI(h)	3.50%	09/25/2050	10,881	1,776,323	0.0
Series 5013, Class JI(h)	4.00%	09/25/2050	18,276	2,776,250	0.0
Series 5018, Class GI(h)	4.50%	10/25/2050	12,680	2,323,517	0.0
Series 5036, Class IT(h)	4.00%	03/25/2050	5,295	961,384	0.0
Series 5049, Class CI(h)	3.50%	12/25/2050	18,504	3,304,353	0.0
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2013-66, Class LI(h)	7.00%	07/25/2043	11,654	2,046,835	0.0
Series 2015-49, Class LI(h)	5.00%	07/25/2045	11,110	2,045,852	0.0
Series 2019-4, Class AI(h)	6.00%	08/25/2038	19,165	3,752,229	0.1
				<u>34,443,718</u>	<u>0.2</u>

VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE

Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4701, Class NS(f) (i)	3.76%	08/15/2039	5,877	685,194	0.0
Series 4736, Class LS(f) (i)	3.81%	12/15/2047	22,442	3,230,374	0.0
Series 4736, Class SM(f) (i)	3.81%	12/15/2047	44,984	6,050,532	0.1
Series 4981, Class JS(f) (i)	3.66%	06/25/2050	80,943	11,783,131	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2005-91, Class SD(f) (i)	4.26%	10/25/2035	4,600	509,858	0.0
Series 2016-64, Class SP(f) (i)	3.56%	09/25/2046	15,668	1,908,328	0.0
Series 2017-97, Class SW(f) (i)	3.76%	12/25/2047	25,754	3,320,105	0.1
Series 2018-36, Class SG(f) (i)	3.76%	06/25/2048	11,023	1,720,451	0.0
Series 2018-43, Class SB(f) (i)	3.76%	06/25/2048	6,016	829,809	0.0
Series 2019-38, Class SM(f) (i)	3.61%	07/25/2049	4,446	771,925	0.0
Series 2019-65, Class SY(f) (i)	3.61%	11/25/2049	9,332	1,389,224	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2017-134, Class MS(f) (i)	3.83%	09/20/2047	6,085	751,411	0.0
Series 2017-161, Class CS(f) (i)	3.88%	10/20/2047	12,020	1,332,182	0.0
Series 2020-47, Class SG(f) (i)	3.63%	02/20/2049	10,503	1,029,126	0.0
				<u>35,311,650</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Alternative Loan Trust, Series 2006-J5, Class 1A1	6.50%	09/25/2036	USD 1,729	\$ 1,086,616	0.0%
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2007-HY4, Class 1A1	3.14%	09/25/2047	1,726	1,574,564	0.0
Residential Asset Securitization Trust, Series 2007-A1, Class A8	6.00%	03/25/2037	3,811	1,483,598	0.0
				<u>4,144,778</u>	<u>0.0</u>
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH					
Alternative Loan Trust, Series 2007-7T2, Class A3(f)	3.04%	04/25/2037	6,145	2,123,473	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust, Series 2007-FA2, Class 1A6(f) (i)	3.11%	04/25/2037	1,560	223,281	0.0
Lehman XS Trust, Series 2007-10H, Class 2AIO(f) (i)	4.63%	07/25/2037	2,524	277,337	0.0
RBSGC Mortgage Loan Trust, Series 2007-B, Class 1A4(f)	2.89%	01/25/2037	848	316,495	0.0
				<u>2,940,586</u>	<u>0.0</u>
				<u>76,840,732</u>	<u>0.5</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class E(f)	9.97%	01/20/2034	2,000	1,850,326	0.0
AGL CLO 16 Ltd., Series 2021-16A, Class E(f)	9.56%	01/20/2035	2,900	2,636,567	0.0
Apidos CLO XXIII, Series 2015-23A, Class ER(f)	8.71%	04/15/2033	1,752	1,569,996	0.0
Elmwood CLO 15 Ltd., Series 2022-2A, Class E(f)	7.89%	04/22/2035	4,200	3,847,717	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class ER(f)	8.86%	10/20/2030	7,000	6,191,850	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2018-29A, Class D(f)	5.84%	10/19/2031	3,000	2,823,759	0.0
Octagon Investment Partners 30 Ltd., Series 2017-1A, Class D(f)	8.91%	03/17/2030	1,000	893,325	0.0
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class E(f)	8.01%	04/15/2031	10,000	7,812,000	0.1
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class E(f)	9.75%	02/25/2034	3,000	2,761,959	0.0
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class E(f)	9.17%	07/20/2034	8,350	7,555,372	0.1
Pikes Peak CLO 10, Series 2022-10A, Class E(f)	8.84%	04/22/2034	6,150	5,684,174	0.0
Wehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class E(f)	7.49%	04/21/2035	11,890	10,948,241	0.1
York CLO-3 Ltd., Series 3A, Class ER(f)	9.11%	10/20/2029	438	399,158	0.0
				<u>54,974,444</u>	<u>0.4</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
State of California, Series 2010	7.60%	11/01/2040	5,645	7,620,932	0.1
State of Illinois, Series 2010	7.35%	07/01/2035	21,250	23,320,048	0.1
Wisconsin Public Finance Authority, Series 2021	5.75%	07/25/2041	15,000	14,174,052	0.1
				<u>45,115,032</u>	<u>0.3</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Digicel Group Holdings Ltd.(a) (c)	7.00%	09/15/2022	1,344	571,006	0.0
ENERGIE					
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd.	7.13%	10/10/2022	INR 2,500,000	31,392,941	0.2
				<u>31,963,947</u>	<u>0.2</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
SNS Bank NV, Series E(c) (j)	11.25%	12/31/2049	EUR 7,579	0	0.0
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Magnetation LLC/Mag Finance Corp.(j) (k)	11.00%	05/15/2018	USD 40,106	1	0.0
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Intelsat Jackson Holdings SA(j)	5.50%	08/01/2023	33,777	0	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA(j)	8.50%	10/15/2024	2,575	0	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA(j)	9.75%	07/15/2025	2,000	0	0.0
				<u>0</u>	<u>0.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Exide Technologies, (Exchange Priority)(j)	11.00%	10/31/2024	27,457	0	0.0
Exide Technologies, (First Lien)(j)	11.00%	10/31/2024	11,269	0	0.0
				<u>0</u>	<u>0.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Castle UK Finco PLC(f)	5.57%	05/15/2028	EUR 10,088	8,710,761	0.1
Castle UK Finco PLC	7.00%	05/15/2029	GBP 17,251	16,053,712	0.1
				<u>24,764,473</u>	<u>0.2</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ENERGIE					
Diamond Foreign Asset Co./Diamond Finance LLC(a)	9.00%	04/22/2027	USD 1,753	\$ 1,678,808	0.0%
Gulfport Energy Corp.	6.00%	10/15/2024	24,233	30,291	0.0
Gulfport Energy Corp.	6.38%	05/15/2025	28,214	35,268	0.0
Gulfport Energy Corp.	6.38%	01/15/2026	20,769	25,961	0.0
Gulfport Energy Corp.	6.63%	05/01/2023	3,218	4,023	0.0
				<u>1,774,351</u>	<u>0.0</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Monitronics International, Inc.(j)	9.13%	04/01/2023	21,822	0	0.0
				<u>26,538,825</u>	<u>0.2</u>
				<u>26,538,825</u>	<u>0.2</u>
SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG					
INFLATIONSGEKÜPTE WERTPAPIERE					
KOLUMBIEN					
Fideicomiso PA Costera	6.25%	01/15/2034	COP 18,690,784	3,763,794	0.0
Fideicomiso PA Pacifico Tres	7.00%	01/15/2035	97,872,936	21,877,220	0.2
				<u>25,641,014</u>	<u>0.2</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
BBFI Liquidating Trust(c) (j)	0.00%	12/30/2099	USD 19,467	11,639,126	0.1
Tonon Luxembourg SA(a) (e) (j)	6.50%	10/31/2024	4,691	469	0.0
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(e) (j)	11.75%	02/09/2022	32,498	3,250	0.0
				<u>11,646,418</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
K201640219 South Africa Ltd.(j)	0.00%	06/25/2023	ZAR 1,003	0	0.0
K2016470219 South Africa Ltd.(a) (j)	3.00%	12/31/2022	USD 16,758	3,691	0.0
K2016470260 South Africa Ltd.(a) (j)	25.00%	12/31/2022	11,747	1,175	0.0
				<u>4,866</u>	<u>0.0</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	25,375	164,938	0.0
				<u>11,816,222</u>	<u>0.1</u>
STAATSANLEIHEN					
GHANA					
Ghana Government International Bond	8.63%	06/16/2049	25,866	9,017,534	0.1
VERSORGBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026	2,777	2,662,230	0.0
				<u>23,495,986</u>	<u>0.2</u>
VORZUGSAKTIE					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Exide International Holdings LP(j)	0.00%		21,353	16,121,515	0.1
ENERGIE					
Gulfport Energy Corp.(c)	10.00%		114	763,800	0.0
				<u>16,885,315</u>	<u>0.1</u>
OPTIONSSCHEINE					
Battalion Oil Corp., expiring 10/08/2022(j)			7,289	0	0.0
SandRidge Energy, Inc. A-CW22, expiring 10/03/2022			94,880	2,846	0.0
SandRidge Energy, Inc. B-CW22, expiring 10/03/2022			39,948	52	0.0
Willscot Corp., expiring 11/29/2022(j)			500,414	12,385,947	0.1
				<u>12,388,845</u>	<u>0.1</u>
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
UKRAINE					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC(e)	7.38%	09/15/2022	USD 10,054	2,513,500	0.0
State Agency of Roads of Ukraine	6.25%	06/24/2030	35,107	6,117,395	0.1
State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC	9.63%	03/20/2025	2,819	1,406,554	0.0
				<u>10,037,449</u>	<u>0.1</u>
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-20, Class PT	11.60%	11/16/2043	365	349,577	0.0
Series 2019-24, Class PT	11.05%	08/15/2044	1,236	1,192,096	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 2019-36, Class PT	12.43%	10/17/2044	USD 2,467	\$ 2,379,587	0.0%
Series 2019-43, Class PT	3.36%	11/15/2044	301	289,733	0.0
Consumer Loan Underlying Bond Club Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-4, Class PT	10.72%	05/15/2043	130	123,172	0.0
Series 2018-12, Class PT	8.48%	06/15/2043	215	204,594	0.0
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust,					
Series 2018-3, Class PT	8.22%	03/16/2043	76	70,287	0.0
SoFi Consumer Loan Program LLC, Series 2016-1, Class R(j)	0.00%	08/25/2025	720	694,687	0.0
				<u>5,303,733</u>	<u>0.0</u>

INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT

FINANZINSTITUTE

BANKWESEN

Lloyds Banking Group PLC(c)	6.00%	06/07/2032	GBP 4,459	<u>4,792,647</u>	<u>0.0</u>
-----------------------------	-------	------------	-----------	------------------	------------

SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN

INDUSTRIE

INVESTITIONSGÜTER

Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	USD 20,393	<u>132,555</u>	<u>0.0</u>
				<u>535,815,903</u>	<u>3.7</u>

Gesamtanlagen

(Kosten \$17,035,435,561)				<u>\$ 14,439,225,909</u>	<u>100.1%</u>
---------------------------	--	--	--	--------------------------	---------------

Termineinlagen

ANZ, Hong Kong(l)	0.80 %	–		160,695	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(l)	1.37 %	–		301,285	0.0
Barclays, London(l)	1.68 %	–		60,463,080	0.4
BBH, Grand Cayman(l)	1.65 %	–		36,061	0.0
BBH, Grand Cayman(l)	4.15 %	–		2,346,454	0.0
BNP Paribas, Paris(l)	0.40 %	–		1,539	0.0
BNP Paribas, Paris(l)	1.10 %	–		98,689	0.0
Sumitomo, London(l)	0.87 %	–		10,271,056	0.1
Sumitomo, Tokyo(l)	(0.13)%	–		<u>3,951,910</u>	<u>0.1</u>

Termineinlagen insgesamt

77,630,769 0.6

Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten

(95,499,316) (0.7)

Nettovermögen

\$ 14,421,357,362 100.0%

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
U.S. Long Bond (CBT) Futures	12/20/2022	285	\$ 38,816,359	\$ 38,715,469	\$ (100,890)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	12/30/2022	6,798	756,133,125	753,356,488	(2,776,637)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	12/20/2022	1,564	184,344,281	182,841,375	(1,502,906)
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Future	12/20/2022	727	91,505,922	91,011,313	494,609
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	12/20/2022	377	56,609,344	56,361,500	247,844
					<u>\$ (3,637,980)</u>
				Wertsteigerung	\$ 742,453
				Wertminderung	\$ (4,380,433)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Bank of America, NA	EUR 161,537	USD 164,338	09/29/2022	\$ 1,885,942
Bank of America, NA	USD 11,574	EUR 11,486	09/29/2022	(10,834)
Barclays Bank PLC	INR 3,612,019	USD 45,330	09/28/2022	519
BNP Paribas SA	COP 159,104,554	USD 34,898	09/15/2022	(952,265)
BNP Paribas SA	EUR 10,232	USD 10,599	09/29/2022	297,433
BNP Paribas SA	USD 17,562	EUR 17,296	09/29/2022	(148,946)
BNP Paribas SA	CAD 19,000	USD 14,737	10/27/2022	275,091
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 26,098	USD 26,591	09/29/2022	315,830
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 1,284,444	USD 903,017	09/06/2022	24,088,680
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 87,893	USD 68,610	09/06/2022	1,687,906
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 17,455	USD 2,551	09/06/2022	18,818
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 2,854	USD 412	09/06/2022	(1,859)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 121,569	USD 124,542	09/06/2022	2,338,850
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3,139	USD 3,139	09/06/2022	(16,404)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 86,047	USD 104,592	09/06/2022	4,624,166

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 64,690	USD 14,089	09/06/2022	\$ 332,345
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 576	USD 120	09/06/2022	(2,008)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 220,692	USD 160,378	09/06/2022	2,451,535
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 41	USD 29	09/06/2022	(1)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,322,907	AUD 1,890,857	09/06/2022	(29,018,014)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 101,296	CAD 130,168	09/06/2022	(2,185,264)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 30	CNH 210	09/06/2022	131
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 34,505	CNH 233,184	09/06/2022	(677,320)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 234	EUR 234	09/06/2022	1,479
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 186,731	EUR 183,125	09/06/2022	(2,651,942)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 154,331	GBP 127,690	09/06/2022	(5,982,414)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 49	PLN 232	09/06/2022	854
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 20,958	PLN 96,955	09/06/2022	(340,137)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 9	SGD 13	09/06/2022	4
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 236,433	SGD 326,040	09/06/2022	(3,121,085)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 805,050	ZAR 13,409,443	09/06/2022	(22,436,934)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 9,043,543	USD 546,640	09/06/2022	18,833,214
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 1,507,307	USD 1,071,049	09/12/2022	39,521,680
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 18,553	USD 19,751	09/12/2022	756,591
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 154,986	USD 159,932	09/12/2022	4,076,096
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3,138	USD 3,139	09/12/2022	(16,432)
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 260,124	USD 167,252	09/12/2022	8,106,103
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,569,040	AUD 2,226,488	09/12/2022	(45,340,019)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 29,181	CHF 27,555	09/12/2022	(970,783)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 234	EUR 234	09/12/2022	1,479
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 239,244	EUR 233,458	09/12/2022	(4,474,946)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 246,103	NZD 386,074	09/12/2022	(9,899,576)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 686,003	ZAR 11,273,655	09/12/2022	(28,393,285)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 7,588,838	USD 468,044	09/12/2022	25,375,134
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 806,377	USD 559,271	09/19/2022	7,357,953
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 45,937	USD 35,554	09/19/2022	580,708
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 15,957	USD 2,330	09/19/2022	14,593
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 2,854	USD 412	09/19/2022	(1,894)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 43,133	USD 52,080	09/19/2022	1,956,500
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 120,108	USD 86,869	09/19/2022	915,085
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 41	USD 29	09/19/2022	(2)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,085,840	AUD 1,566,778	09/19/2022	(13,480,730)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 69,441	CAD 89,772	09/19/2022	(1,095,439)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 30	CNH 210	09/19/2022	132
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 32,882	CNH 223,092	09/19/2022	(514,957)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 101,094	GBP 84,161	09/19/2022	(3,292,077)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 9	SGD 13	09/19/2022	4
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 168,984	SGD 233,843	09/19/2022	(1,637,041)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 868,562	ZAR 14,595,355	09/19/2022	(17,784,437)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 7,373,222	USD 441,697	09/19/2022	11,904,382
Citibank, NA	USD 12,505	EUR 12,524	09/29/2022	104,115
HSBC Bank USA	EUR 388,829	USD 398,051	09/09/2022	7,119,023
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR 67,265	USD 68,888	09/29/2022	1,165,762
Morgan Stanley & Co., Inc.	EUR 33,116	USD 33,802	09/29/2022	461,228
Royal Bank of Scotland PLC	EUR 10,982	USD 11,245	09/29/2022	188,470
Royal Bank of Scotland PLC	USD 9,533	EUR 9,385	09/29/2022	(84,952)
Royal Bank of Scotland PLC	GBP 61,012	USD 72,507	11/17/2022	1,525,156
Societe Generale	EUR 9,397	USD 9,743	09/29/2022	282,224
Standard Chartered Bank	USD 8,529	EUR 8,495	09/29/2022	23,911
State Street Bank & Trust Co.	EUR 13,147	USD 13,437	09/29/2022	200,799
UBS AG	EUR 10,888	USD 11,132	09/29/2022	169,501
UBS AG	USD 15,159	EUR 15,142	09/29/2022	85,213
				<u>\$ (25,487,358)</u>
			Wertsteigerung	\$ 169,044,639
			Wertminderung	\$ (194,531,997)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte					
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 38, 5 Year Index	06/20/2027	USD 1,830,609	\$ (22,435,285)	\$ (72,801,308)
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Ford Motor Company	06/20/2023	USD 6,370	162,301	312,844
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 37, 5 Year Index	06/20/2027	EUR 783,800	(26,484,630)	(67,458,733)
Insgesamt				<u>\$ (48,757,614)</u>	<u>\$ (139,947,197)</u>
				Wertsteigerung	\$ 312,844
				Wertminderung	\$ (140,260,041)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 17,420	\$ (7,302,560)	\$ (8,251,133)	\$ 948,573
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 9,238	(3,872,702)	(4,445,635)	572,933
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 21,677	(9,087,199)	(9,458,934)	371,735
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 1,929	(808,700)	(239,172)	(569,528)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,858	(1,617,400)	(567,776)	(1,049,624)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,858	(1,617,400)	(57,102)	(1,560,298)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 7,717	(3,234,800)	(1,055,651)	(2,179,149)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 7,717	(3,234,800)	63,366	(3,298,166)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 14,380	(6,028,049)	(2,200,899)	(3,827,150)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 19,292	(8,086,999)	(4,095,835)	(3,991,164)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 880	(191,439)	(92,781)	(98,658)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,210	(263,228)	(156,962)	(106,266)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,666	(797,662)	(443,916)	(353,746)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,322	(1,158,046)	(545,336)	(612,710)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,639	(574,317)	(268,799)	(305,518)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 14,342	(3,120,773)	(1,383,766)	(1,737,007)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 87,391	(19,016,262)	(7,879,426)	(11,136,836)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,199	(478,597)	(211,438)	(267,159)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,199	(478,597)	(210,044)	(268,553)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,023	(657,912)	(306,092)	(351,820)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,447	(967,724)	(475,475)	(492,249)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 7,331	(1,595,324)	(829,566)	(765,758)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,484	(1,460,512)	(1,648,064)	187,552
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,484	(1,460,512)	(1,648,064)	187,552
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 11,452	(4,800,865)	(2,112,097)	(2,688,768)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 39,145	(16,409,491)	(7,588,001)	(8,821,490)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,254	(708,164)	(805,753)	97,589
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 23	(5,105)	(3,044)	(2,061)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 6,509	(1,416,329)	(1,387,772)	(28,557)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 6,509	(1,416,329)	(1,387,772)	(28,557)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,254	(708,164)	(671,630)	(36,534)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,556	(338,687)	(153,243)	(185,444)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,666	(797,662)	(346,491)	(451,171)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 6,225	(1,354,590)	(608,492)	(746,098)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 10,997	(2,392,986)	(1,444,671)	(948,315)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 12,719	(2,767,568)	(1,251,540)	(1,516,028)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 18,329	(3,988,310)	(2,377,198)	(1,611,112)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 64,334	(13,999,128)	(9,106,067)	(4,893,061)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,858	(1,617,400)	(527,825)	(1,089,575)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 7,717	(3,234,800)	(1,055,651)	(2,179,149)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,666	(797,662)	(475,074)	(322,588)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,565	(775,647)	(342,444)	(433,203)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,666	(797,662)	(362,295)	(435,367)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 7,331	(1,595,324)	(1,026,986)	(568,338)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 7,331	(1,595,324)	(960,751)	(634,573)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 10,997	(2,392,986)	(1,543,917)	(849,069)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 7,331	(1,595,324)	(720,522)	(874,802)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 10,997	(2,392,986)	(1,425,221)	(967,765)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 14,663	(3,190,648)	(1,950,117)	(1,240,531)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 18,329	(3,988,310)	(2,567,465)	(1,420,845)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 36,657	(7,976,620)	(4,860,297)	(3,116,323)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 6,968	(2,921,024)	(3,225,968)	304,944
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 5,397	(2,262,419)	(2,358,079)	95,660
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,249	(942,621)	(933,672)	(8,949)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 5,397	(2,262,419)	(2,179,076)	(83,343)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 5,397	(2,262,419)	(2,166,333)	(96,086)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 5,396	(2,262,095)	(2,153,282)	(108,813)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 5,396	(2,262,095)	(2,140,541)	(121,554)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 6,159	(2,581,694)	(2,179,834)	(401,860)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 6,159	(2,581,694)	(2,165,439)	(416,255)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,858	(1,617,400)	(345,425)	(1,271,975)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 16,272	(3,540,822)	(4,103,112)	562,290
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 16,272	(3,540,822)	(3,804,943)	264,121
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 953	(207,392)	(116,898)	(90,494)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 7,331	(1,595,324)	(953,057)	(642,267)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 8,469	(1,842,918)	(803,499)	(1,039,419)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 18,329	(3,988,310)	(2,310,384)	(1,677,926)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 13,937	\$ (3,032,711)	\$ (1,335,212)	\$ (1,697,499)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 14,931	(3,248,877)	(1,489,542)	(1,759,335)
Insgesamt				<u>\$ (203,118,641)</u>	<u>\$ (128,235,132)</u>	<u>\$ (74,883,509)</u>
					Wertsteigerung	\$ 3,592,949
					Wertminderung	\$ (78,476,458)
Swaps insgesamt						<u>\$ (214,830,706)</u>

- (a) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (b) Wandelbares Wertpapier.
- (c) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (d) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 31. August 2022.
- (e) Not leidend.
- (f) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. August 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) Notleidendes fälliges Wertpapier.
- (l) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

- ABS – Asset-Backed Securities
- 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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds	3.38%	08/15/2042	USD 200,555	\$ 196,387,227	1.2%
U.S. Treasury Bonds	6.13%	11/15/2027	344,064	388,685,252	2.4
U.S. Treasury Bonds(a)	6.13%	08/15/2029	537,115	632,116,627	3.8
U.S. Treasury Bonds(a)	6.25%	05/15/2030	747,077	900,228,026	5.4
U.S. Treasury Bonds	6.75%	08/15/2026	13,643	15,322,682	0.1
U.S. Treasury Bonds	7.63%	02/15/2025	217,311	237,887,307	1.4
U.S. Treasury Notes	2.63%	05/31/2027	72,073	69,899,358	0.4
U.S. Treasury Notes	2.88%	08/31/2027	1,257,127	1,247,894,712	7.5
U.S. Treasury Notes	3.25%	08/31/2024	90,480	90,126,069	0.6
				<u>3,778,547,260</u>	<u>22.8</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
ASP Unifrax Holdings, Inc.	5.25%	09/30/2028	8,819	7,190,627	0.1
Avient Corp.	5.75%	05/15/2025	3,318	3,271,322	0.0
Avient Corp.	7.13%	08/01/2030	8,812	8,714,500	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026	1,879	1,900,350	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.38%	04/01/2031	5,000	4,149,245	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	7,573	6,899,249	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	6.13%	04/15/2032	45,235	41,943,394	0.3
Glatfelter Corp.	4.75%	11/15/2029	8,295	5,164,748	0.0
Graphic Packaging International LLC	4.75%	07/15/2027	4,299	4,101,618	0.0
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	27,796	23,855,916	0.2
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	26,838	25,574,091	0.2
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	5.38%	11/01/2026	22,466	18,641,691	0.1
WR Grace Holdings LLC	4.88%	06/15/2027	6,793	6,312,605	0.0
				<u>157,719,356</u>	<u>1.0</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance PLC	6.00%	06/15/2027	3,559	3,484,973	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	04/30/2025	5,709	5,437,823	0.0
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	4,501	4,221,784	0.0
Eco Material Technologies, Inc.	7.88%	01/31/2027	19,423	18,012,708	0.1
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	41,527	38,419,236	0.2
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	7,955	6,849,408	0.1
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	4,000	3,663,940	0.0
Stevens Holding Co., Inc.	6.13%	10/01/2026	4,933	4,915,802	0.0
TK Elevator US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	21,995	20,018,994	0.1
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024	8,943	9,015,124	0.1
Wesco Distribution, Inc.	7.13%	06/15/2025	10,456	10,498,584	0.1
Wesco Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	9,211	9,299,733	0.1
				<u>133,838,109</u>	<u>0.8</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	37,082	31,891,853	0.2
Altice Financing SA	5.00%	01/15/2028	42,199	34,251,604	0.2
Altice Financing SA	5.75%	08/15/2029	24,913	20,102,887	0.1
Banjay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025	3,926	3,710,363	0.0
Belo Corp.	7.75%	06/01/2027	2,604	2,546,244	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	10,354	8,714,196	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	06/01/2033	61,959	49,007,769	0.3
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.75%	02/01/2032	10,382	8,598,431	0.1
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	8,724	7,829,526	0.1
CSC Holdings LLC	3.38%	02/15/2031	5,991	4,493,894	0.0
CSC Holdings LLC	5.00%	11/15/2031	23,052	16,548,913	0.1
CSC Holdings LLC	5.75%	01/15/2030	37,402	28,952,740	0.2
DISH DBS Corp.	5.25%	12/01/2026	25,055	20,716,044	0.1
DISH DBS Corp.	5.75%	12/01/2028	28,439	21,888,557	0.1
DISH DBS Corp.	7.75%	07/01/2026	5,157	4,062,245	0.0
Gray Escrow II, Inc.	5.38%	11/15/2031	42,997	36,352,836	0.2
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	22,917	21,656,308	0.1
McGraw-Hill Education, Inc.	5.75%	08/01/2028	40,341	35,422,199	0.2
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026	8,693	4,347,731	0.0
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028	14,789	10,438,322	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	17,585	13,784,826	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	3.88%	09/01/2031	10,359	8,377,306	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029	20,137	18,840,419	0.1
Summer BC Bidco B LLC	5.50%	10/31/2026	700	609,168	0.0
Univision Communications, Inc.	4.50%	05/01/2029	8,302	7,258,698	0.0
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	27,939	27,053,775	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Univision Communications, Inc.	7.38%	06/30/2030	USD 16,494	\$ 16,364,602	0.1%
Virgin Media Secured Finance PLC	4.50%	08/15/2030	946	786,878	0.0
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	794	635,567	0.0
Ziggo BV	4.88%	01/15/2030	24,189	20,670,416	0.1
				485,914,317	2.9
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026	40,042	36,638,430	0.2
Consolidated Communications, Inc.	5.00%	10/01/2028	5,895	4,560,539	0.0
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	32,651	26,604,467	0.2
Embarq Corp.	8.00%	06/01/2036	21,303	16,484,666	0.1
Iliad Holding SASU	6.50%	10/15/2026	14,216	13,025,233	0.1
Iliad Holding SASU	7.00%	10/15/2028	9,698	8,931,902	0.1
Lumen Technologies, Inc., Series Y	7.50%	04/01/2024	17,638	17,998,540	0.1
Telecom Italia Capital SA	7.20%	07/18/2036	9,850	8,405,669	0.1
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	7,678	6,630,639	0.0
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.75%	07/15/2031	6,675	5,479,718	0.0
				144,759,803	0.9
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.50%	04/01/2027	4,888	4,568,528	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.88%	07/01/2028	10,159	9,653,822	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	6.25%	05/15/2026	20,680	20,455,611	0.1
Dana, Inc.	4.25%	09/01/2030	5,591	4,539,170	0.0
Dana, Inc.	5.38%	11/15/2027	12,089	10,786,865	0.1
Ford Motor Co.	6.10%	08/19/2032	65,028	63,413,819	0.3
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.00%	07/15/2029	2,698	2,419,776	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.25%	07/15/2031	2,860	2,466,306	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(b)	6.00%	05/15/2027	23,494	20,909,707	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(b)	6.38%	05/15/2029	12,577	11,102,594	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.50%	07/15/2029	22,261	16,324,318	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	01/15/2028	31,879	24,234,782	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	7.75%	10/15/2025	34,461	32,322,693	0.2
Meritor, Inc.	6.25%	06/01/2025	10,388	10,712,625	0.1
Tenneco, Inc.	7.88%	01/15/2029	8,241	8,286,125	0.1
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025	14,495	13,666,353	0.1
				255,863,094	1.5
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	4.00%	08/01/2028	13,272	11,015,760	0.1
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	58,296	45,325,140	0.3
Carnival Corp.	9.88%	08/01/2027	10,000	10,019,500	0.1
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./Magnum Management Corp./Millennium Op	5.50%	05/01/2025	52,796	51,937,759	0.3
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.38%	07/15/2027	18,007	14,000,442	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	08/31/2026	23,060	18,377,436	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	04/01/2028	15,887	11,994,685	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	10.88%	06/01/2023	31,966	32,466,588	0.2
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025	34,310	36,413,546	0.2
Six Flags Theme Parks, Inc.	7.00%	07/01/2025	5,175	5,232,423	0.0
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025	8,044	8,059,668	0.0
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd.	5.63%	02/15/2029	8,267	6,758,961	0.0
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028	21,681	18,322,083	0.1
				269,923,991	1.6
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025	14,225	12,414,628	0.1
Beazer Homes USA, Inc.	6.75%	03/15/2025	500	477,888	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	4.88%	02/15/2030	28,915	22,345,986	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027	49,014	43,589,334	0.3
Builders FirstSource, Inc.	6.38%	06/15/2032	5,000	4,638,945	0.0
Caesars Entertainment, Inc.	6.25%	07/01/2025	29,496	28,798,431	0.2
Empire Communities Corp.	7.00%	12/15/2025	8,518	7,326,209	0.1
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	5,196	4,804,033	0.0
International Game Technology PLC	5.25%	01/15/2029	3,337	3,107,857	0.0
International Game Technology PLC	6.25%	01/15/2027	35,757	35,063,413	0.2
KB Home	4.80%	11/15/2029	2,965	2,529,822	0.0
KB Home	6.88%	06/15/2027	4,102	4,064,629	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc.	6.13%	09/15/2025	3,034	3,030,881	0.0
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	7,000	5,648,623	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	19,163	15,986,731	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	8,959	8,265,330	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	15,629	15,110,006	0.1
Travel + Leisure Co.	4.50%	12/01/2029	27,347	22,232,814	0.1
Travel + Leisure Co.	4.63%	03/01/2030	3,108	2,536,581	0.0
Travel + Leisure Co.	6.63%	07/31/2026	13,210	12,809,671	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.25%	05/15/2027	USD 11,291	\$ 10,181,311	0.1%
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	13,465	11,303,820	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	7.75%	04/15/2025	14,262	14,221,684	0.1
				<u>290,488,627</u>	<u>1.8</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Arko Corp.	5.13%	11/15/2029	11,996	10,035,434	0.1
Asbury Automotive Group, Inc.	5.00%	02/15/2032	10,155	8,483,888	0.1
Bath & Body Works, Inc.	5.25%	02/01/2028	5,737	5,149,629	0.0
Bath & Body Works, Inc.	6.63%	10/01/2030	11,017	10,012,678	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.75%	07/01/2036	25,820	22,284,598	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.88%	11/01/2035	21,725	18,985,481	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.95%	03/01/2033	329	270,938	0.0
Bath & Body Works, Inc.	7.50%	06/15/2029	7,154	6,881,588	0.0
Bath & Body Works, Inc.	7.60%	07/15/2037	716	591,610	0.0
FirstCash, Inc.	4.63%	09/01/2028	7,381	6,486,601	0.0
FirstCash, Inc.	5.63%	01/01/2030	21,733	19,445,839	0.1
Michaels Cos, Inc. (The)	5.25%	05/01/2028	23,129	17,744,121	0.1
Murphy Oil USA, Inc.	4.75%	09/15/2029	11,452	10,519,290	0.1
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	4.75%	02/15/2028	33,180	29,863,112	0.2
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp.	6.38%	09/30/2026	10,386	9,240,053	0.1
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026	24,937	21,080,958	0.1
Wolverine World Wide, Inc.	4.00%	08/15/2029	5,890	4,815,753	0.0
				<u>201,891,571</u>	<u>1.2</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
AdaptHealth LLC.	6.13%	08/01/2028	6,613	6,217,189	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.	4.88%	02/15/2030	15,673	13,741,404	0.1
Bausch Health Americas, Inc.	8.50%	01/31/2027	4,505	2,161,273	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	6.25%	02/15/2029	17,487	6,599,884	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	9.00%	12/15/2025	271	174,131	0.0
CD&R Smokey Buyer, Inc.	6.75%	07/15/2025	1,977	1,847,432	0.0
Darling Ingredients, Inc.	6.00%	06/15/2030	9,928	9,937,666	0.1
Emergent BioSolutions, Inc.	3.88%	08/15/2028	1,537	1,026,139	0.0
Garden Spinco Corp.	8.63%	07/20/2030	10,941	11,646,079	0.1
Grifols Escrow Issuer SA.	4.75%	10/15/2028	7,443	6,308,878	0.0
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc.	5.00%	12/31/2026	33,210	30,106,824	0.2
Legacy LifePoint Health LLC.	6.75%	04/15/2025	64,710	63,528,683	0.4
ModivCare Escrow Issuer, Inc.	5.00%	10/01/2029	2,163	1,920,325	0.0
Post Holdings, Inc.	4.50%	09/15/2031	8,368	7,114,954	0.1
Post Holdings, Inc.	4.63%	04/15/2030	5,000	4,343,642	0.0
Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029	6,547	6,001,552	0.0
Post Holdings, Inc.	5.63%	01/15/2028	7,135	6,778,347	0.1
RP Escrow Issuer LLC.	5.25%	12/15/2025	24,848	22,414,211	0.1
US Acute Care Solutions LLC.	6.38%	03/01/2026	9,491	8,553,677	0.1
				<u>210,422,290</u>	<u>1.3</u>
ENERGIE					
Berry Petroleum Co. LLC.	7.00%	02/15/2026	3,175	2,984,335	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.63%	12/15/2025	11,064	11,059,457	0.1
Cheniere Energy Partners LP.	4.50%	10/01/2029	4,266	3,930,232	0.0
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	13,237	12,725,501	0.1
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	45,862	44,747,226	0.3
Civitas Resources, Inc.	5.00%	10/15/2026	4,730	4,464,975	0.0
CNX Resources Corp.	6.00%	01/15/2029	13,971	13,144,132	0.1
Comstock Resources, Inc.	5.88%	01/15/2030	2,995	2,758,542	0.0
CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC.	5.50%	06/15/2031	16,660	14,742,713	0.1
Crescent Energy Finance LLC.	7.25%	05/01/2026	15,590	14,905,256	0.1
Encino Acquisition Partners Holdings LLC.	8.50%	05/01/2028	12,292	11,728,673	0.1
EnLink Midstream LLC.	5.63%	01/15/2028	17,787	17,106,746	0.1
EnLink Midstream Partners LP.	4.40%	04/01/2024	804	806,474	0.0
EnLink Midstream Partners LP.	5.05%	04/01/2045	12,996	9,385,296	0.1
EnLink Midstream Partners LP.	5.45%	06/01/2047	10,303	7,869,128	0.1
EnLink Midstream Partners LP.	5.60%	04/01/2044	1,916	1,519,996	0.0
EQM Midstream Partners LP.	4.50%	01/15/2029	16,753	14,583,493	0.1
EQM Midstream Partners LP.	4.75%	01/15/2031	15,247	13,178,216	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.25%	05/15/2026	5,083	4,641,832	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.50%	10/01/2025	3,830	3,565,096	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	40,175	37,461,927	0.2
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	8.00%	01/15/2027	28,318	26,831,432	0.2
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	6.88%	01/15/2029	11,607	10,657,115	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	08/01/2027	7,835	7,458,480	0.1
Harbour Energy PLC.	5.50%	10/15/2026	7,343	6,712,598	0.0
Hess Midstream Operations LP.	4.25%	02/15/2030	206	177,631	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.75%	02/01/2029	5,408	4,969,157	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.00%	02/01/2031	7,941	7,194,669	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Ithaca Energy North Sea PLC	9.00%	07/15/2026	USD 6,979	\$ 6,813,957	0.0%
ITT Holdings LLC	6.50%	08/01/2029	36,137	30,649,472	0.2
Nabors Industries, Inc.	7.38%	05/15/2027	17,675	17,056,675	0.1
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	22,561	21,824,380	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	02/01/2026	54,939	49,734,106	0.3
Occidental Petroleum Corp.	5.88%	09/01/2025	5,779	5,928,293	0.0
Occidental Petroleum Corp.	6.13%	01/01/2031	4,679	4,872,800	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.00%	07/15/2025	10,610	11,497,030	0.1
Occidental Petroleum Corp.	8.50%	07/15/2027	5,994	6,715,378	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.88%	07/15/2030	6,994	8,183,265	0.1
PDC Energy, Inc.	5.75%	05/15/2026	8,594	8,232,383	0.1
PDC Energy, Inc.	6.13%	09/15/2024	3,417	3,406,731	0.0
Southwestern Energy Co.	5.38%	02/01/2029	3,267	3,091,984	0.0
Summit Midstream Holdings LLC/ Summit Midstream Finance Corp.	8.50%	10/15/2026	14,264	13,861,700	0.1
Transocean Phoenix 2 Ltd.	7.75%	10/15/2024	4,184	4,107,699	0.0
				<u>507,286,181</u>	<u>3.1</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Interface, Inc.	5.50%	12/01/2028	5,810	5,139,489	0.0
DIENSTLEISTUNGEN					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	46,602	43,626,685	0.2
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL	4.63%	06/01/2028	21,890	18,472,564	0.1
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	14,450	14,177,151	0.1
Aramark Services, Inc.	6.38%	05/01/2025	13,856	13,697,802	0.1
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	13,634	12,266,300	0.1
ION Trading Technologies SARL	5.75%	05/15/2028	11,107	9,464,593	0.1
Millennium Escrow Corp.	6.63%	08/01/2026	24,610	20,092,176	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.50%	09/01/2028	26,526	22,608,239	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028	34,084	27,043,151	0.1
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	5.63%	10/01/2028	10,002	10,041,619	0.1
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	5.88%	10/01/2030	3,599	3,610,748	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.25%	04/15/2024	9,896	9,809,423	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026	12,000	11,581,544	0.1
Ritchie Bros Auctioneers, Inc.	5.38%	01/15/2025	575	570,976	0.0
Sabre GLOBL, Inc.	7.38%	09/01/2025	2,660	2,521,243	0.0
Sabre GLOBL, Inc.	9.25%	04/15/2025	17,308	17,056,068	0.1
TripAdvisor, Inc.	7.00%	07/15/2025	9,576	9,414,421	0.1
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	5,706	5,503,403	0.0
ZipRecruiter, Inc.	5.00%	01/15/2030	19,625	16,418,017	0.1
				<u>267,976,123</u>	<u>1.6</u>
TECHNOLOGIE					
Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025	6,123	6,096,770	0.0
CommScope, Inc.	6.00%	03/01/2026	210	198,596	0.0
Dell International LLC/EMC Corp.	5.85%	07/15/2025	6,238	6,458,762	0.0
Entegris Escrow Corp.	5.95%	06/15/2030	12,650	12,006,381	0.1
GoTo Group, Inc.	5.50%	09/01/2027	3,670	2,695,888	0.0
NCR Corp.	5.75%	09/01/2027	10,151	9,827,721	0.1
NCR Corp.	6.13%	09/01/2029	7,437	7,119,587	0.0
Seagate HDD Cayman	4.09%	06/01/2029	5,300	4,556,551	0.0
Sensata Technologies BV	5.88%	09/01/2030	10,263	10,029,284	0.1
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	09/01/2025	76,800	59,177,348	0.4
				<u>118,166,888</u>	<u>0.7</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Allegiant Travel Co.	7.25%	08/15/2027	10,577	10,512,711	0.1
American Airlines, Inc.	11.75%	07/15/2025	5,000	5,523,446	0.0
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.50%	04/20/2026	8,593	8,180,787	0.0
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.75%	04/20/2029	13,211	11,933,666	0.1
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./HawaiianMiles Loyalty Ltd.	5.75%	01/20/2026	10,686	9,757,184	0.1
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	30,569	31,068,725	0.2
				<u>76,976,519</u>	<u>0.5</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	6.13%	10/15/2026	19,507	17,432,612	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	4.75%	04/01/2028	15,737	13,744,323	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.38%	03/01/2029	3,641	3,175,680	0.0
PROG Holdings, Inc.	6.00%	11/15/2029	16,432	13,785,453	0.1
				<u>48,138,068</u>	<u>0.3</u>
				<u>3,174,504,426</u>	<u>19.2</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(c)	6.50%	03/05/2025	48,200	45,140,890	0.3
Banco Santander SA(c)	7.50%	02/08/2024	18,600	18,341,587	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Bread Financial Holdings, Inc.	4.75%	12/15/2024	USD 33,539	\$ 29,647,517	0.2%
Bread Financial Holdings, Inc.	7.00%	01/15/2026	15,902	14,311,800	0.1
Credit Suisse Group AG.	6.25%	12/18/2024	33,000	29,700,000	0.2
Credit Suisse Group AG(c)	6.25%	12/18/2024	12,694	11,424,600	0.1
Credit Suisse Group AG(c)	7.50%	07/17/2023	5,000	4,422,694	0.0
Credit Suisse Group AG.	7.50%	07/17/2023	27,754	24,549,488	0.2
Credit Suisse Group AG(c)	7.50%	12/11/2023	2,004	1,903,800	0.0
Credit Suisse Group AG.	7.50%	12/11/2023	25,000	23,733,289	0.1
Credit Suisse Group AG.	9.75%	06/23/2027	1,083	1,095,184	0.0
Intesa Sanpaolo SpA	5.02%	06/26/2024	29,505	28,352,717	0.2
Intesa Sanpaolo SpA	5.71%	01/15/2026	3,000	2,854,526	0.0
Societe Generale SA(c)	7.88%	12/18/2023	9,332	9,238,680	0.0
Societe Generale SA(c)	8.00%	09/29/2025	16,232	16,311,211	0.1
				<u>261,027,983</u>	<u>1.6</u>
MAKLER					
AG Ttmt Escrow Issuer LLC.	8.63%	09/30/2027	23,499	23,506,925	0.1
Jane Street Group/JSG Finance, Inc.	4.50%	11/15/2029	17,383	15,779,360	0.1
NFP Corp.	4.88%	08/15/2028	8,605	7,634,472	0.1
NFP Corp.	7.50%	10/01/2030	17,419	17,165,053	0.1
				<u>64,085,810</u>	<u>0.4</u>
FINANZEN					
Aircastle Ltd.(c)	5.25%	06/15/2026	15,194	12,024,050	0.1
Castlelake Aviation Finance DAC	5.00%	04/15/2027	10,524	9,051,747	0.0
goeasy Ltd.	5.38%	12/01/2024	21,183	20,005,143	0.1
Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp.	5.00%	08/15/2028	15,619	13,330,200	0.1
				<u>54,411,140</u>	<u>0.3</u>
REITs					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	4.50%	04/01/2027	29,109	24,983,130	0.0
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	5.75%	05/15/2026	9,735	9,124,844	0.1
Diversified Healthcare Trust	9.75%	06/15/2025	13,966	13,725,391	0.1
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2029	10,460	9,077,301	0.0
Iron Mountain, Inc.	5.00%	07/15/2028	10,020	9,146,860	0.1
Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028	11,339	10,470,617	0.1
Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/ PK Finance Co-Issuer	4.88%	05/15/2029	13,793	12,154,203	0.1
				<u>88,682,346</u>	<u>0.5</u>
				<u>468,207,279</u>	<u>2.8</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Calpine Corp.	5.13%	03/15/2028	21,905	19,566,438	0.1
Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026	7,871	7,545,699	0.1
Vistra Corp.(c)	7.00%	12/15/2026	16,102	14,974,860	0.1
Vistra Corp.(c)	8.00%	10/15/2026	19,514	18,684,655	0.1
Vistra Operations Co. LLC	5.63%	02/15/2027	18,523	17,905,921	0.1
				<u>78,677,573</u>	<u>0.5</u>
				<u>3,721,389,278</u>	<u>22.5</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV	4.80%	04/18/2026	7,000	6,865,756	0.0
AIB Group PLC	4.26%	04/10/2025	60,316	58,795,832	0.4
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	11,107	12,284,523	0.1
AmSouth Bancorp.	6.75%	11/01/2025	11,929	12,677,277	0.1
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	4.40%	05/19/2026	8,780	8,596,631	0.1
Australia & New Zealand Banking Group Ltd./United Kingdom . .	6.75%	06/15/2026	43,923	43,838,628	0.3
Banco Santander SA	4.18%	03/24/2028	13,200	12,439,752	0.1
Banco Santander SA	5.18%	11/19/2025	74,800	74,183,492	0.4
Bank of America Corp., Series B.	8.05%	06/15/2027	34,006	37,420,334	0.2
Bank of America Corp., Series X(c)	6.25%	09/05/2024	15,203	15,071,529	0.1
Bank of America Corp., Series Z(c)	6.50%	10/23/2024	14,620	14,742,903	0.1
Barclays Bank PLC	7.63%	11/21/2022	8,608	8,651,512	0.1
Barclays PLC(c)	8.00%	03/15/2029	26,640	25,970,793	0.2
BBVA USA	5.90%	04/01/2026	7,500	7,846,024	0.0
BNP Paribas SA.	4.63%	03/13/2027	13,920	13,567,607	0.1
BNP Paribas SA.	7.75%	08/16/2029	18,753	18,700,178	0.1
BPCE SA	4.63%	07/11/2024	17,050	16,853,689	0.1
BPCE SA	5.15%	07/21/2024	23,413	23,260,543	0.1
Capital One Financial Corp.	4.93%	05/10/2028	19,600	19,368,125	0.1
Citigroup, Inc.(c)	3.88%	02/18/2026	24,915	21,637,944	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Citigroup, Inc.(c)	5.95%	01/30/2023	USD 14,902	\$ 14,761,034	0.1%
Citigroup, Inc., Series P(c)	5.95%	05/15/2025	10,465	10,063,770	0.1
Citigroup, Inc., Series U(c)	5.00%	09/12/2024	26,500	24,612,569	0.1
Citigroup, Inc., Series V(c)	4.70%	01/30/2025	9,977	8,448,116	0.1
Citigroup, Inc., Series W(c)	4.00%	12/10/2025	16,145	14,165,713	0.1
Commerzbank AG	8.13%	09/19/2023	12,284	12,544,715	0.1
Credit Agricole SA(c)	8.13%	12/23/2025	21,494	22,004,482	0.1
Credit Agricole SA	8.13%	03/23/2171	19,693	20,165,286	0.1
Danske Bank A/S	4.30%	04/01/2028	34,018	31,923,552	0.2
Deutsche Bank AG/New York NY	6.12%	07/14/2026	24,309	24,343,835	0.1
Discover Bank	4.68%	08/09/2028	42,248	40,909,027	0.2
Dresdner Funding Trust I	8.15%	06/30/2031	11,620	12,758,609	0.1
Federation des Caisses Desjardins du Quebec	4.55%	08/23/2027	33,130	32,511,954	0.2
First-Citizens Bank & Trust Co.	2.97%	09/27/2025	2,736	2,612,204	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series O(c)	5.30%	11/10/2026	1,910	1,845,267	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(c)	5.00%	11/10/2022	15,687	14,762,913	0.1
HSBC Holdings PLC	4.76%	03/29/2033	17,054	15,281,796	0.1
HSBC Holdings PLC(c)	6.38%	03/30/2025	9,850	9,505,250	0.1
HSBC Holdings PLC(c)	6.50%	03/23/2028	17,335	16,132,626	0.1
ING Groep NV(c)	6.75%	04/16/2024	31,733	31,035,227	0.2
JPMorgan Chase & Co.	4.32%	04/26/2028	43,463	42,469,832	0.2
JPMorgan Chase & Co.	4.57%	06/14/2030	17,051	16,588,791	0.1
JPMorgan Chase & Co., Series S(c)	6.75%	02/01/2024	13,340	13,475,388	0.1
Lloyds Banking Group PLC	4.58%	12/10/2025	22,665	22,146,830	0.1
Lloyds Banking Group PLC(c)	7.50%	06/27/2024	25,585	25,226,073	0.1
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	5.02%	07/20/2028	19,113	19,247,521	0.1
Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.	4.60%	03/27/2024	17,908	17,833,641	0.1
Morgan Stanley	4.21%	04/20/2028	17,502	17,038,927	0.1
Nordea Bank Abp(c)	6.63%	03/26/2026	59,046	57,964,454	0.3
Santander Holdings USA, Inc.	4.40%	07/13/2027	51,158	49,261,540	0.3
Skandinaviska Enskilda Banken AB	6.88%	06/30/2027	600	588,887	0.0
Societe Generale SA	4.25%	04/14/2025	11,148	10,887,234	0.1
Societe Generale SA	4.25%	08/19/2026	17,260	16,497,805	0.1
Societe Generale SA	4.75%	11/24/2025	22,112	21,637,468	0.2
Standard Chartered PLC(c) (d)	4.32%	01/30/2027	34,013	27,210,321	0.2
Standard Chartered PLC(c)	7.75%	04/02/2023	988	992,822	0.0
Standard Chartered PLC	7.75%	04/02/2023	1,505	1,512,345	0.0
Standard Chartered PLC	7.75%	02/15/2171	881	856,583	0.0
Svenska Handelsbanken AB	4.38%	03/01/2027	1,800	1,551,236	0.0
Svenska Handelsbanken AB	4.75%	03/01/2031	13,600	11,070,809	0.1
Swedbank AB, Series NC5	5.63%	09/17/2024	13,600	13,233,570	0.1
UBS AG	5.13%	05/15/2024	7,742	7,756,902	0.0
UBS Group AG	4.49%	05/12/2026	4,473	4,432,608	0.0
UBS Group AG(c)	7.00%	01/31/2024	12,992	12,717,634	0.1
UBS Group AG(c)	7.00%	02/19/2025	28,847	29,006,447	0.2
UniCredit SpA	4.63%	04/12/2027	1,425	1,337,465	0.0
UniCredit SpA	7.83%	12/04/2023	24,650	25,212,663	0.1
				<u>1,280,916,813</u>	<u>7.7</u>
MAKLER					
Charles Schwab Corp. (The), Series G(c)	5.38%	06/01/2025	39,660	39,535,068	0.2
FINANZEN					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	2.88%	08/14/2024	3,072	2,942,780	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.00%	10/29/2028	35,999	30,875,583	0.2
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.30%	01/23/2023	162	161,194	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.88%	01/23/2028	7,258	6,617,275	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	10/01/2025	12,253	11,882,336	0.1
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	6.50%	07/15/2025	3,140	3,217,940	0.0
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	8,142	6,649,981	0.1
Aircastle Ltd.	4.13%	05/01/2024	4,820	4,708,390	0.0
Aircastle Ltd.	4.25%	06/15/2026	1,132	1,042,749	0.0
Aircastle Ltd.	4.40%	09/25/2023	12,230	12,176,378	0.1
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	46,031	44,344,028	0.3
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	5,354	4,621,254	0.0
Aviation Capital Group LLC	1.95%	09/20/2026	13,175	11,054,636	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	8,286	7,086,076	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	117	109,397	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	4,985	4,752,448	0.0
Synchrony Financial	2.88%	10/28/2031	18	13,885	0.0
Synchrony Financial	3.95%	12/01/2027	6,078	5,528,295	0.0
Synchrony Financial	4.88%	06/13/2025	32,687	32,210,480	0.2
Synchrony Financial	5.15%	03/19/2029	1,500	1,427,600	0.0
				<u>191,422,705</u>	<u>1.2</u>
VERSICHERUNGEN					
ACE Capital Trust II	9.70%	04/01/2030	31,826	40,836,925	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	USD 8,665	\$ 8,819,696	0.1%
Allstate Corp. (The), Series B	5.75%	08/15/2053	35,856	32,877,585	0.2
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.63%	08/15/2052	21,351	20,363,673	0.1
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.75%	08/15/2050	18,619	18,183,035	0.1
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co., Ltd.	5.63%	06/24/2046	3,300	3,315,983	0.0
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(d)	5.03%	02/12/2047	61,341	51,027,935	0.3
Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037	6,501	7,513,478	0.0
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	11,997	13,306,662	0.1
MetLife, Inc.	6.40%	12/15/2036	7,456	7,681,225	0.0
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039	8,590	11,712,423	0.1
Nationwide Mutual Insurance Co.(d)	4.12%	12/15/2024	1,000	999,386	0.0
Prudential Financial, Inc.	5.20%	03/15/2044	42,601	41,373,897	0.3
Prudential Financial, Inc.	5.63%	06/15/2043	52,407	52,202,473	0.3
Swiss Re Finance Luxembourg SA	5.00%	04/02/2049	15,690	14,930,107	0.1
Voya Financial, Inc.	5.65%	05/15/2053	68,904	67,528,542	0.4
				<u>392,673,025</u>	<u>2.4</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	04/03/2026	6,125	5,920,662	0.0
REITs					
Brixmor Operating Partnership LP	4.05%	07/01/2030	62	55,164	0.0
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.25%	06/01/2025	14,960	14,756,373	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.38%	04/15/2026	5,190	5,110,950	0.0
Kite Realty Group LP	4.00%	10/01/2026	2,785	2,648,552	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	4.63%	08/01/2029	9,147	7,687,154	0.1
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.25%	08/01/2026	13,581	12,998,444	0.1
Office Properties Income Trust	3.45%	10/15/2031	14,840	9,843,914	0.1
Omega Healthcare Investors, Inc.	4.50%	01/15/2025	3,865	3,828,044	0.0
Omega Healthcare Investors, Inc.	5.25%	01/15/2026	5,503	5,459,290	0.0
Realty Income Corp.	3.40%	01/15/2028	7,691	7,214,937	0.1
SITE Centers Corp.	4.70%	06/01/2027	18,600	17,949,516	0.1
Spirit Realty LP	4.00%	07/15/2029	14,882	13,502,695	0.1
STORE Capital Corp.	4.63%	03/15/2029	4,573	4,427,870	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	5.63%	05/01/2024	1,235	1,236,778	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	5.75%	02/01/2027	19,477	19,171,572	0.1
				<u>125,891,253</u>	<u>0.8</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024	35,753	34,828,910	0.2
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	30,672	30,072,642	0.2
				<u>64,901,552</u>	<u>0.4</u>
				<u>2,101,261,078</u>	<u>12.7</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Arconic Corp.	6.00%	05/15/2025	29,005	28,533,385	0.1
Celanese US Holdings LLC.	5.90%	07/05/2024	8,615	8,684,348	0.1
Celanese US Holdings LLC.	6.05%	03/15/2025	8,615	8,638,686	0.1
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043	5,949	5,293,379	0.0
CF Industries, Inc.	5.15%	03/15/2034	367	354,089	0.0
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044	14,821	13,883,872	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.40%	11/14/2034	9,609	9,094,271	0.1
Huntsman International LLC	4.50%	05/01/2029	13,936	12,833,387	0.1
MEGlobal Canada ULC.	5.00%	05/18/2025	5,875	5,904,375	0.0
MEGlobal Canada ULC.	5.88%	05/18/2030	3,112	3,246,789	0.0
Rohm & Haas Co.	7.85%	07/15/2029	19,000	22,183,605	0.1
Suzano Austria GmbH, Series DM3N	3.13%	01/15/2032	4,108	3,247,887	0.0
				<u>121,898,073</u>	<u>0.7</u>
INVESTITIONSGÜTER					
General Electric Co., Series D(c) (d)	5.16%	12/15/2022	41,196	39,000,250	0.2
Parker-Hannifin Corp.	4.50%	09/15/2029	31,682	31,175,454	0.2
				<u>70,175,704</u>	<u>0.4</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Directv Financing LLC/Directv Financing Co-Obligor, Inc.	5.88%	08/15/2027	13,188	12,068,349	0.1
Magallanes, Inc.	4.05%	03/15/2029	3,850	3,497,046	0.0
Magallanes, Inc.	4.28%	03/15/2032	19,532	16,966,574	0.1
Omnicom Group, Inc.	4.20%	06/01/2030	42	39,933	0.0
Time Warner Entertainment Co. LP.	8.38%	07/15/2033	15,020	17,238,652	0.1
				<u>49,810,554</u>	<u>0.3</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc.	7.13%	12/15/2031	3,042	3,411,610	0.0
British Telecommunications PLC	5.13%	12/04/2028	10,440	10,268,351	0.1
British Telecommunications PLC	9.63%	12/15/2030	39,776	49,155,100	0.2
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/					
Sprint Spectrum Co. III LLC.	4.74%	03/20/2025	9,793	9,826,588	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC	5.15%	03/20/2028	USD 9,140	\$ 9,241,999	0.1%
				<u>81,903,648</u>	<u>0.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
General Motors Co.	6.13%	10/01/2025	14	14,418	0.0
General Motors Co.	6.25%	10/02/2043	7,450	7,120,014	0.0
General Motors Co.	6.80%	10/01/2027	15	15,918	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	4.00%	10/06/2026	62	59,649	0.0
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.05%	02/14/2027	13,435	11,991,731	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	12,998	12,462,603	0.1
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030	57	49,583	0.0
Nissan Motor Co., Ltd.	4.35%	09/17/2027	20,699	19,242,193	0.1
				<u>50,956,109</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Genting New York LLC/GENNY Capital, Inc.	3.30%	02/15/2026	17,897	15,999,353	0.1
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	3,723	3,052,953	0.1
Owens Corning	7.00%	12/01/2036	1,449	1,565,780	0.0
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	1,352	1,371,500	0.0
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	1,500	1,672,925	0.0
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	4.63%	04/06/2031	20,600	16,048,397	0.1
				<u>39,710,908</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Macy's Retail Holdings LLC	5.88%	03/15/2030	4,040	3,453,287	0.0
Ross Stores, Inc.	4.70%	04/15/2027	14,291	14,349,406	0.1
				<u>17,802,693</u>	<u>0.1</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Altria Group, Inc.	4.80%	02/14/2029	38,826	37,591,032	0.2
BAT International Finance PLC	4.45%	03/16/2028	36,222	34,494,743	0.2
				<u>72,085,775</u>	<u>0.4</u>
ENERGIE					
Boardwalk Pipelines LP	4.45%	07/15/2027	6,893	6,618,736	0.0
Boardwalk Pipelines LP	4.80%	05/03/2029	19,313	18,561,393	0.1
Cenovus Energy, Inc.	4.40%	04/15/2029	8,488	8,204,076	0.1
Cenovus Energy, Inc.	5.38%	07/15/2025	10,606	10,886,742	0.1
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	428	466,120	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	12,633	12,074,843	0.1
Enbridge Energy Partners LP	7.38%	10/15/2045	6,505	7,747,677	0.1
Energy Transfer LP	4.40%	03/15/2027	71,587	69,343,678	0.4
Energy Transfer LP	4.95%	05/15/2028	6,435	6,282,499	0.0
Energy Transfer LP	5.50%	06/01/2027	23,075	23,352,669	0.1
Energy Transfer LP	8.25%	11/15/2029	11,355	13,000,702	0.1
Eni SpA	4.25%	05/09/2029	12,712	12,115,206	0.1
Eni SpA, Series X-R	4.75%	09/12/2028	1,500	1,486,230	0.0
Hess Corp.	7.30%	08/15/2031	45,274	50,554,422	0.3
Hess Corp.	7.88%	10/01/2029	16,239	18,550,069	0.1
Kinder Morgan Energy Partners LP	7.30%	08/15/2033	9,000	9,982,637	0.1
Marathon Oil Corp.	4.40%	07/15/2027	201	195,488	0.0
Marathon Oil Corp.	6.80%	03/15/2032	10,144	10,843,996	0.1
ONEOK, Inc.	4.35%	03/15/2029	21,411	20,217,861	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	9,649	9,404,216	0.1
Saudi Arabian Oil Co.	2.25%	11/24/2030	3,461	3,007,609	0.0
Suncor Energy, Inc.	7.15%	02/01/2032	12,130	13,533,201	0.1
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp.	6.50%	07/15/2027	15,917	16,371,329	0.1
Tennessee Gas Pipeline Co. LLC	7.00%	10/15/2028	19,360	20,849,957	0.1
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	22,413	21,446,337	0.1
Western Midstream Operating LP	4.50%	03/01/2028	4,159	3,865,142	0.0
Western Midstream Operating LP	4.65%	07/01/2026	12,047	11,524,430	0.1
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	7,998	7,538,362	0.0
				<u>408,025,627</u>	<u>2.5</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025	36	36,938	0.0
Global Payments, Inc.	5.30%	08/15/2029	8,683	8,591,988	0.1
RELX Capital, Inc.	4.75%	05/20/2032	5,389	5,412,641	0.0
				<u>14,041,567</u>	<u>0.1</u>
TECHNOLOGIE					
Broadcom, Inc.	3.14%	11/15/2035	2,915	2,209,935	0.0
Broadcom, Inc.	3.19%	11/15/2036	61,106	45,333,245	0.3
Broadcom, Inc.	4.00%	04/15/2029	3,991	3,699,716	0.0
Broadcom, Inc.	4.15%	04/15/2032	19,296	17,278,805	0.1
Broadcom, Inc.	4.93%	05/15/2037	10,043	8,960,615	0.1
Entegris Escrow Corp.	4.75%	04/15/2029	35,879	33,017,829	0.2
HP, Inc.	4.75%	01/15/2028	33,320	32,812,938	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Leidos, Inc.....	7.13%	07/01/2032	USD 2,000	\$ 2,131,671	0.0%
NXP BV/NXP Funding LLC.....	5.35%	03/01/2026	21,052	21,459,883	0.1
Western Digital Corp.	3.10%	02/01/2032	3,634	2,739,374	0.0
				<u>169,644,011</u>	<u>1.0</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	31,075	29,751,205	0.2
Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.....	6.50%	06/20/2027	59,148	59,325,585	0.4
				<u>89,076,790</u>	<u>0.6</u>
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
BNSF Funding Trust I.....	6.61%	12/15/2055	5,597	5,509,859	0.0
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Ashtead Capital, Inc.	5.50%	08/11/2032	4,450	4,373,136	0.0
				<u>1,195,014,454</u>	<u>7.2</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
NRG Energy, Inc.....	3.75%	06/15/2024	10,265	9,963,444	0.1
				<u>3,306,238,976</u>	<u>20.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Absa Group Ltd.....	6.38%	05/27/2026	4,093	3,752,258	0.0
Banco de Credito del Peru S.A.....	3.13%	07/01/2030	20,748	19,088,160	0.1
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	5.38%	04/17/2025	23,905	24,014,067	0.1
BBVA Bancomer SA/Texas.....	5.88%	09/13/2034	26,946	24,685,904	0.2
				<u>71,540,389</u>	<u>0.4</u>
FINANZEN					
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.....	4.75%	04/27/2027	400	331,450	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.....	5.50%	01/16/2025	39,399	36,562,272	0.2
				<u>36,893,722</u>	<u>0.2</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
OEC Finance Ltd.(b).....	4.38%	10/25/2029	5,023	154,890	0.0
OEC Finance Ltd.(b).....	7.13%	12/26/2046	12,883	334,387	0.0
				<u>489,277</u>	<u>0.0</u>
REITs					
China Aoyuan Group Ltd.(e).....	5.38%	09/13/2022	531	33,188	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(e).....	5.88%	03/01/2027	5,486	342,875	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(e).....	5.98%	08/18/2025	433	26,467	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(e).....	7.95%	02/19/2023	913	57,234	0.0
China SCE Group Holdings Ltd.....	6.00%	02/04/2026	2,671	510,495	0.0
China SCE Group Holdings Ltd.....	7.00%	05/02/2025	1,440	299,520	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e).....	9.38%	06/30/2024	1,573	174,800	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e).....	9.95%	07/23/2025	5,483	609,298	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e).....	10.50%	01/15/2025	764	84,518	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e).....	11.65%	06/01/2026	1,137	124,928	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(e).....	11.70%	11/11/2025	623	68,063	0.0
KWG Group Holdings Ltd.....	5.95%	08/10/2025	1,601	203,927	0.0
KWG Group Holdings Ltd.....	6.00%	08/14/2026	400	49,575	0.0
KWG Group Holdings Ltd.....	7.40%	01/13/2027	347	43,375	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.....	4.90%	05/13/2026	642	80,250	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.....	5.95%	04/30/2025	940	109,451	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.....	6.25%	08/10/2024	364	48,867	0.0
Shimao Group Holdings Ltd.(e).....	5.20%	01/16/2027	1,491	197,557	0.0
Shimao Group Holdings Ltd.(e).....	5.60%	07/15/2026	270	36,450	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e).....	5.95%	04/26/2024	1,297	181,580	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e).....	6.50%	01/10/2025	2,260	316,400	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e).....	6.50%	01/26/2026	1,087	152,180	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e).....	6.65%	08/03/2024	282	39,480	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e).....	6.80%	10/20/2024	724	101,360	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(e).....	7.00%	07/09/2025	316	44,240	0.0
Times China Holdings Ltd.....	5.55%	06/04/2024	2,235	391,125	0.0
Times China Holdings Ltd.....	5.75%	01/14/2027	1,726	241,640	0.0
Times China Holdings Ltd.....	6.60%	03/02/2023	490	120,050	0.0
Times China Holdings Ltd.....	6.75%	07/08/2025	703	105,450	0.0
Trust Fibra Uno.....	4.87%	01/15/2030	29,764	25,559,835	0.2
Yango Justice International Ltd.(e).....	7.50%	04/15/2024	727	39,985	0.0
Yango Justice International Ltd.(e).....	7.50%	02/17/2025	7,372	405,460	0.0
Yango Justice International Ltd.(e).....	7.88%	09/04/2024	2,391	131,505	0.0
Yango Justice International Ltd.(e).....	8.25%	11/25/2023	1,343	73,865	0.0
Yango Justice International Ltd.(e).....	9.25%	04/15/2023	630	34,650	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Yango Justice International Ltd.(e)	10.25%	09/15/2022	USD 335	\$ 19,011	0.0%
Zhenro Properties Group Ltd.(e)	7.10%	09/10/2024	587	23,480	0.0
				<u>31,082,134</u>	<u>0.2</u>
				<u>140,005,522</u>	<u>0.8</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Anglo American Capital PLC	5.63%	04/01/2030	40,450	40,204,772	0.3
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	23,386	18,124,150	0.1
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	4,456	3,840,515	0.0
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	20,153	17,709,449	0.1
Cia de Minas Buenaventura SAA	5.50%	07/23/2026	2,050	1,797,338	0.0
CSN Inova Ventures	6.75%	01/28/2028	11,082	10,465,287	0.1
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	24,154	18,591,334	0.1
Eldorado Gold Corp.	6.25%	09/01/2029	12,403	9,918,524	0.1
Freeport Indonesia PT	4.76%	04/14/2027	5,354	5,200,072	0.0
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.	5.13%	05/15/2024	8,685	8,730,053	0.1
GUSAP III LP	4.25%	01/21/2030	9,269	8,623,182	0.1
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	22,607	21,691,416	0.1
Industrias Penoles SAB de CV	5.65%	09/12/2049	4,016	3,637,743	0.0
Nexa Resources SA	5.38%	05/04/2027	16,701	16,015,215	0.1
OCP SA	3.75%	06/23/2031	6,361	5,183,420	0.0
Sasol Financing USA LLC.	5.88%	03/27/2024	8,684	8,653,606	0.1
Stillwater Mining Co.	4.00%	11/16/2026	5,644	4,973,070	0.0
Stillwater Mining Co.	4.50%	11/16/2029	5,188	4,230,814	0.0
Suzano Austria GmbH	5.00%	01/15/2030	6,570	6,131,124	0.0
Vedanta Resources Finance II PLC	8.95%	03/11/2025	20,226	15,574,020	0.1
Volcan Cia Minera SAA.	4.38%	02/11/2026	1,974	1,709,731	0.0
				<u>231,004,835</u>	<u>1.4</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Cemex SAB de CV	5.13%	06/08/2026	16,029	13,284,034	0.1
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	6,522	6,587,220	0.0
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	26,107	25,149,134	0.2
Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028	14,202	14,133,653	0.1
IHS Holding Ltd.	5.63%	11/29/2026	6,475	5,575,784	0.0
IHS Holding Ltd.	6.25%	11/29/2028	2,727	2,297,498	0.0
Usiminas International SARL	5.88%	07/18/2026	11,294	11,027,885	0.1
				<u>78,055,208</u>	<u>0.5</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	10,669	8,697,235	0.1
Prosus NV	4.03%	08/03/2050	7,314	4,627,476	0.0
VTR Finance NV	6.38%	07/15/2028	3,891	1,710,338	0.0
Weibo Corp.	3.50%	07/05/2024	28,740	27,742,866	0.2
				<u>42,777,915</u>	<u>0.3</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	21,849	19,307,958	0.1
CT Trust	5.13%	02/03/2032	2,965	2,567,352	0.0
HTA Group Ltd./Mauritius	7.00%	12/18/2025	20,951	19,619,302	0.1
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	30,147	27,870,558	0.2
				<u>69,365,170</u>	<u>0.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Falabella SA.	3.75%	10/30/2027	4,335	4,077,067	0.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
BRF SA	4.88%	01/24/2030	27,471	23,184,151	0.2
Central American Bottling Corp./CBC Bottling Holdco SL/ Beliv Holdco SL	5.25%	04/27/2029	2,894	2,666,097	0.0
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	2.43%	07/01/2031	10,259	8,566,265	0.0
MARB BondCo PLC	3.95%	01/29/2031	8,466	6,673,854	0.0
Natura & Co., Luxembourg Holdings SARL	6.00%	04/19/2029	15,717	13,819,172	0.1
NBM US Holdings, Inc.	6.63%	08/06/2029	10,000	9,714,375	0.1
Ulker Biskuvi Sanayi AS	6.95%	10/30/2025	3,907	2,769,819	0.0
				<u>67,393,733</u>	<u>0.4</u>
ENERGIE					
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	10,939	9,224,995	0.1
Ecopetrol SA	4.63%	11/02/2031	5,838	4,531,748	0.0
Ecopetrol SA	5.88%	11/02/2051	7,071	4,684,537	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	24,762	22,951,403	0.1
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	4,306	3,557,573	0.0
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.	5.50%	04/06/2025	10,110	9,099,000	0.1
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	2,624	2,476,400	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028	1,854	1,756,650	0.0
Medco Platinum Road Pte Ltd.	6.75%	01/30/2025	18,656	17,779,168	0.1
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	10,837	9,969,654	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	USD 8,487	\$ 7,256,385	0.0%
Peru LNG SRL	5.38%	03/22/2030	11,304	9,551,880	0.1
Raizen Fuels Finance SA	5.30%	01/20/2027	16,179	16,108,217	0.1
SEPLAT Energy PLC	7.75%	04/01/2026	11,120	9,785,600	0.1
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	06/15/2028	5,998	4,381,179	0.0
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026	25,480	21,853,877	0.1
				<u>154,968,266</u>	<u>0.9</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Bidvest Group UK PLC (The)	3.63%	09/23/2026	9,421	8,606,083	0.1
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	345	312,389	0.0
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	26,695	23,892,025	0.1
NXP BV/NXP Funding LLC	5.55%	12/01/2028	1,500	1,531,406	0.0
				<u>25,735,820</u>	<u>0.1</u>
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	4,347	3,901,819	0.0
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	9,104	8,967,803	0.1
				<u>12,869,622</u>	<u>0.1</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.00%	07/30/2027	23,925	21,821,095	0.1
JSW Infrastructure Ltd.	4.95%	01/21/2029	3,094	2,558,932	0.0
				<u>24,380,027</u>	<u>0.1</u>
				<u>719,233,746</u>	<u>4.3</u>
STAATSANLEIHEN					
ANGOLA					
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	17,946	14,850,315	0.1
Angolan Government International Bond	9.50%	11/12/2025	12,861	12,250,102	0.1
				<u>27,100,417</u>	<u>0.2</u>
BRASILIEN					
Brazilian Government International Bond	8.25%	01/20/2034	15,326	17,354,779	0.1
KOLUMBIEN					
Colombia Government International Bond	3.13%	04/15/2031	4,454	3,358,038	0.0
Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	47,384	34,898,316	0.2
Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	11,769	8,520,020	0.1
Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	29,991	23,914,073	0.1
Colombia Government International Bond	7.38%	09/18/2037	9,114	8,631,528	0.1
				<u>79,321,975</u>	<u>0.5</u>
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
Dominican Republic International Bond	4.50%	01/30/2030	75,271	63,077,098	0.4
Dominican Republic International Bond	4.88%	09/23/2032	19,203	15,468,016	0.1
Dominican Republic International Bond	5.50%	02/22/2029	6,306	5,737,672	0.0
Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028	8,000	7,634,000	0.1
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	2,096	2,196,608	0.0
				<u>94,113,394</u>	<u>0.6</u>
ECUADOR					
Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	3,678	1,242,140	0.0
Ecuador Government International Bond	1.50%	07/31/2040	9,839	3,362,346	0.0
Ecuador Government International Bond	2.50%	07/31/2035	26,864	10,288,943	0.1
Ecuador Government International Bond	5.50%	07/31/2030	12,724	6,670,764	0.0
				<u>21,564,193</u>	<u>0.1</u>
ÄGYPTEN					
Egypt Government International Bond	6.59%	02/21/2028	9,640	7,543,300	0.0
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	6,969	4,869,589	0.0
Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	41,608	34,950,720	0.2
Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	62,112	43,373,586	0.3
				<u>90,737,195</u>	<u>0.5</u>
EL SALVADOR					
El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	23,539	12,475,670	0.1
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	15,000	5,641,875	0.1
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	9,532	3,171,177	0.0
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	13,501	4,959,930	0.0
				<u>26,248,652</u>	<u>0.2</u>
GHANA					
Ghana Government International Bond	6.38%	02/11/2027	21,220	9,177,650	0.1
Ghana Government International Bond	7.88%	03/26/2027	14,024	6,135,500	0.0
Ghana Government International Bond	8.63%	04/07/2034	10,289	3,704,040	0.0
Ghana Government International Bond	10.75%	10/14/2030	503	360,903	0.0
				<u>19,378,093</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
ELFENBEINKÜSTE					
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	USD 18,113	\$ 15,229,637	0.1%
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	39,769	<u>36,918,060</u>	<u>0.2</u>
				<u>52,147,697</u>	<u>0.3</u>
KENIA					
Republic of Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	19,297	15,341,115	0.1
Republic of Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028	11,890	<u>9,214,750</u>	<u>0.0</u>
				<u>24,555,865</u>	<u>0.1</u>
NIGERIA					
Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	7,834	5,632,156	0.0
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	13,971	8,592,165	0.1
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	12,210	7,783,875	0.1
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	5,591	<u>4,011,543</u>	<u>0.0</u>
				<u>26,019,739</u>	<u>0.2</u>
PAKISTAN					
Pakistan Government International Bond	6.00%	04/08/2026	12,053	7,474,186	0.0
Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	589	362,300	0.0
Pakistan Government International Bond	7.38%	04/08/2031	19,018	<u>10,557,082</u>	<u>0.1</u>
				<u>18,393,568</u>	<u>0.1</u>
PANAMA					
Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026	32,190	<u>31,612,592</u>	<u>0.2</u>
SENEGAL					
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	43,004	34,626,283	0.2
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	22,447	<u>15,604,874</u>	<u>0.1</u>
				<u>50,231,157</u>	<u>0.3</u>
SÜDAFRIKA					
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	45,168	32,012,820	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	6.30%	06/22/2048	14,391	<u>11,142,232</u>	<u>0.1</u>
				<u>43,155,052</u>	<u>0.3</u>
UKRAINE					
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2035	32,227	5,639,725	0.0
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2034	68,051	12,079,052	0.1
Ukraine Government International Bond	8.99%	02/01/2026	10,000	<u>2,100,000</u>	<u>0.0</u>
				<u>19,818,777</u>	<u>0.1</u>
				<u>641,753,145</u>	<u>3.9</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	3.75%	01/14/2028	7,817	7,151,578	0.0
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.38%	02/15/2031	19,852	15,792,266	0.1
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	5,785	5,409,380	0.0
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	05/31/2030	11,919	10,326,324	0.1
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA	4.38%	06/18/2026	9,592	8,319,861	0.0
Kallpa Generacion SA	4.13%	08/16/2027	10,259	9,540,870	0.1
Adani Transmission Step-One Ltd.	4.00%	08/03/2026	15,853	14,870,114	0.1
AES Andes SA	6.35%	10/07/2079	12,300	11,385,187	0.1
LLPL Capital Pte Ltd.	6.88%	02/04/2039	9,482	9,096,054	0.0
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033	11,725	11,344,054	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	24,989	20,456,620	0.1
India Clean Energy Holdings	4.50%	04/18/2027	13,448	10,220,480	0.1
JSW Hydro Energy Ltd.	4.13%	05/18/2031	3,102	2,501,763	0.0
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	11,154	<u>9,996,773</u>	<u>0.1</u>
				<u>146,411,324</u>	<u>0.9</u>
				<u>1,647,403,737</u>	<u>9.9</u>
BEHÖRDEN					
SCHULDVERSCHREIBUNGEN VON BEHÖRDEN					
Federal Home Loan Banks	3.25%	06/09/2028	34,000	33,587,306	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp.	6.25%	07/15/2032	119,285	146,494,350	0.9
Federal Home Loan Mortgage Corp.	6.75%	03/15/2031	65,181	80,716,249	0.5
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series GDIF	6.75%	09/15/2029	8,750	10,542,114	0.1
Federal National Mortgage Association	6.25%	05/15/2029	120,037	140,317,980	0.8
Federal National Mortgage Association	6.63%	11/15/2030	358,671	438,956,770	2.7
Federal National Mortgage Association	7.13%	01/15/2030	142,912	176,903,193	1.1
Federal National Mortgage Association	7.25%	05/15/2030	15,000	18,818,944	0.1
Tennessee Valley Authority	7.13%	05/01/2030	19,383	<u>23,919,503</u>	<u>0.1</u>
				<u>1,070,256,409</u>	<u>6.5</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-1A, Class B1(d)	6.69%	04/25/2028	2,270	2,256,838	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 2018-3A, Class M1B(d)	4.29%	10/25/2028	USD 1,955	\$ 1,953,011	0.0%
Series 2019-1A, Class M2(d)	5.14%	03/25/2029	13,043	13,067,554	0.1
Series 2019-2A, Class M1C(d)	4.44%	04/25/2029	51,941	51,819,828	0.3
Series 2019-2A, Class M2(d)	5.54%	04/25/2029	5,000	4,915,264	0.0
Series 2019-3A, Class M1C(d)	4.39%	07/25/2029	49,916	49,511,855	0.3
Series 2019-4A, Class M1B(d)	4.44%	10/25/2029	370	369,957	0.0
Series 2019-4A, Class M1C(d)	4.94%	10/25/2029	25,958	26,026,144	0.2
Series 2019-4A, Class M2(d)	5.29%	10/25/2029	40,849	39,258,683	0.2
Series 2020-3A, Class M2(d)	7.29%	10/25/2030	4,250	4,273,418	0.0
Eagle RE Ltd.					
Series 2018-1, Class M1(d)	4.14%	11/25/2028	2,145	2,132,916	0.0
Series 2019-1, Class M1B(d)	4.24%	04/25/2029	1,278	1,273,750	0.0
Series 2019-1, Class M2(d)	5.74%	04/25/2029	5,236	5,181,756	0.0
Series 2020-1, Class M2(d)	4.44%	01/25/2030	15,704	14,738,719	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2014-DN4, Class M3(d)	6.99%	10/25/2024	6,022	6,190,450	0.0
Series 2014-HQ2, Class M3(d)	6.19%	09/25/2024	1,440	1,473,089	0.0
Series 2015-HQA1, Class M3(d)	7.14%	03/25/2028	11,289	11,631,327	0.1
Series 2015-HQA2, Class M3(d)	7.24%	05/25/2028	11,909	12,252,535	0.1
Series 2016-HQA3, Class M3(d)	6.29%	03/25/2029	1,960	1,996,949	0.0
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2013-C01, Class M2(d)	7.69%	10/25/2023	1,515	1,558,509	0.0
Series 2014-C01, Class M2(d)	6.84%	01/25/2024	1,198	1,221,681	0.0
Series 2014-C03, Class 2M2(d)	5.34%	07/25/2024	409	408,806	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(d)	7.34%	11/25/2024	7,749	8,105,002	0.1
Series 2014-C04, Class 2M2(d)	7.44%	11/25/2024	413	416,902	0.0
Series 2015-C04, Class 2M2(d)	7.99%	04/25/2028	21,170	21,858,106	0.1
Series 2016-C01, Class 1M2(d)	9.19%	08/25/2028	9,834	10,475,122	0.1
Series 2016-C01, Class 2M2(d)	9.39%	08/25/2028	6,535	6,780,363	0.0
Series 2016-C02, Class 1M2(d)	8.44%	09/25/2028	19,643	20,580,284	0.1
Series 2016-C03, Class 1M2(d)	7.74%	10/25/2028	11,684	11,861,083	0.1
Series 2017-C03, Class 1B1(d)	7.29%	10/25/2029	10,420	10,999,536	0.1
Home Re Ltd.					
Series 2018-1, Class M1(d)	4.04%	10/25/2028	16	15,789	0.0
Series 2018-1, Class M2(d)	5.44%	10/25/2028	1,062	1,054,346	0.0
Series 2019-1, Class M2(d)	5.69%	05/25/2029	5,400	5,357,257	0.0
Oaktown Re II Ltd., Series 2018-1A, Class M1(d)	3.99%	07/25/2028	380	380,181	0.0
Oaktown Re III Ltd., Series 2019-1A, Class M2(d)	4.99%	07/25/2029	23,910	23,757,260	0.2
Oaktown Re V Ltd., Series 2020-2A, Class M2(d)	7.69%	10/25/2030	4,014	4,081,858	0.0
PMT Credit Risk Transfer Trust					
Series 2019-2R, Class A(d)	5.24%	05/27/2023	14,690	14,399,560	0.1
Series 2019-3R, Class A(d)	5.19%	10/27/2022	4,723	4,706,981	0.0
Radnor RE Ltd.					
Series 2019-1, Class M1B(d)	4.39%	02/25/2029	12,742	12,636,042	0.1
Series 2019-1, Class M2(d)	5.64%	02/25/2029	12,181	11,800,784	0.1
Series 2019-2, Class M1B(d)	4.19%	06/25/2029	8,572	8,559,226	0.1
Series 2020-1, Class M1B(d)	3.89%	01/25/2030	22,546	22,413,220	0.1
Series 2020-1, Class M1C(d)	4.19%	01/25/2030	8,262	7,892,564	0.1
Triangle Re Ltd., Series 2020-1, Class M1C(d)	6.94%	10/25/2030	2,656	2,659,255	0.0
				<u>464,303,760</u>	<u>2.8</u>

VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE

Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs

Series 3119, Class PI(d) (f)	4.81%	02/15/2036	3,655	605,073	0.0
Series 3898, Class NS(d) (f)	3.54%	07/15/2041	5,615	531,226	0.0
Series 3921, Class SB(d) (f)	4.17%	09/15/2041	11,997	1,677,333	0.0
Series 3928, Class SE(d) (f)	4.19%	09/15/2041	10,741	1,463,756	0.0
Series 4125, Class SA(d) (f)	3.76%	11/15/2042	7,043	870,888	0.0
Series 4248, Class SL(d) (f)	3.66%	05/15/2041	2,040	190,203	0.0
Series 4494, Class SL(d) (f)	3.83%	07/15/2045	31,713	4,061,604	0.1
Series 4495, Class SA(d) (f)	3.76%	07/15/2045	7,257	990,079	0.0
Series 4585, Class DS(d) (f)	3.61%	05/15/2046	15,893	2,015,696	0.0
Series 4656, Class SK(d) (f)	3.66%	02/15/2047	8,237	1,028,395	0.0
Series 4707, Class LS(d) (f)	3.76%	08/15/2047	9,649	1,216,492	0.0
Series 4719, Class SB(d) (f)	3.76%	09/15/2047	16,240	2,130,746	0.0
Series 4727, Class AS(d) (f)	3.81%	11/15/2047	13,562	1,827,762	0.0
Series 4754, Class QS(d) (f)	3.76%	02/15/2048	13,306	1,854,937	0.0
Series 4767, Class SB(d) (f)	3.81%	03/15/2048	5,461	691,869	0.0
Series 4824, Class KS(d) (f)	3.81%	09/15/2048	5,095	677,029	0.0
Series 4932, Class SM(d) (f)	3.61%	06/25/2049	24,912	2,843,631	0.0
Series 4954, Class SL(d) (f)	3.61%	02/25/2050	274	31,678	0.0
Series 4981, Class HS(d) (f)	3.66%	06/25/2050	73,041	8,520,815	0.1

Federal National Mortgage Association REMICs

Series 2005-58, Class IK(d) (f)	3.56%	07/25/2035	7,318	926,319	0.0
Series 2011-146, Class SA(d) (f)	3.56%	01/25/2042	8,544	1,048,526	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2012-122, Class LS(d) (f)	3.66%	11/25/2042	USD 7,635	\$ 986,178	0.0%
Series 2012-122, Class MS(d) (f)	3.66%	11/25/2042	8,197	1,131,204	0.0
Series 2012-17, Class SE(d) (f)	3.51%	03/25/2042	7,849	1,173,747	0.0
Series 2012-7, Class QS(d) (f)	3.56%	02/25/2042	10,932	1,341,858	0.0
Series 2012-70, Class HS(d) (f)	3.56%	07/25/2042	12,783	1,570,360	0.0
Series 2013-15, Class SA(d) (f)	3.71%	03/25/2043	6,746	871,637	0.0
Series 2013-4, Class ST(d) (f)	3.71%	02/25/2043	7,532	982,644	0.0
Series 2014-17, Class SB(d) (f)	3.61%	04/25/2044	8,455	1,104,944	0.0
Series 2014-28, Class SB(d) (f)	3.61%	05/25/2044	7,620	1,118,092	0.0
Series 2014-40, Class HS(d) (f)	4.26%	07/25/2044	5,194	914,730	0.0
Series 2014-78, Class SA(d) (f)	3.66%	12/25/2044	4,402	626,973	0.0
Series 2014-88, Class BS(d) (f)	3.71%	01/25/2045	7,258	917,082	0.0
Series 2015-26, Class SH(d) (f)	4.01%	05/25/2045	11,055	1,655,592	0.0
Series 2015-90, Class SL(d) (f)	3.71%	12/25/2045	9,355	1,176,629	0.0
Series 2016-29, Class SA(d) (f)	3.56%	05/25/2046	10,639	1,314,907	0.0
Series 2016-89, Class SH(d) (f)	3.56%	12/25/2046	5,749	712,824	0.0
Series 2017-105, Class SE(d) (f)	3.71%	01/25/2048	37,713	4,889,219	0.1
Series 2017-112, Class SA(d) (f)	3.71%	01/25/2048	10,350	1,343,109	0.0
Series 2017-20, Class SJ(d) (f)	3.66%	04/25/2047	22,594	2,938,896	0.0
Series 2017-26, Class TS(d) (f)	3.51%	04/25/2047	7,925	1,036,458	0.0
Series 2017-35, Class LS(d) (f)	3.71%	05/25/2047	24,730	3,231,051	0.1
Series 2017-38, Class DS(d) (f)	3.76%	05/25/2047	8,313	542,507	0.0
Series 2017-38, Class SE(d) (f)	3.66%	05/25/2047	17,156	2,201,204	0.0
Series 2018-28, Class PS(d) (f)	3.76%	05/25/2048	13,116	1,696,954	0.0
Series 2018-28, Class SB(d) (f)	3.76%	05/25/2048	13,625	1,807,948	0.0
Series 2018-30, Class SA(d) (f)	3.76%	05/25/2048	13,194	1,638,728	0.0
Series 2018-32, Class SB(d) (f)	3.76%	05/25/2048	13,706	1,816,422	0.0
Series 2018-45, Class SL(d) (f)	3.76%	06/25/2048	10,110	1,378,824	0.0
Series 2018-96, Class SC(d) (f)	3.61%	10/25/2035	5,361	482,771	0.0
Series 2019-13, Class SA(d) (f)	3.56%	04/25/2049	12,379	1,406,069	0.0
Series 2019-25, Class SA(d) (f)	3.61%	06/25/2049	30,083	3,774,363	0.1
Series 2019-31, Class SJ(d) (f)	3.66%	07/25/2049	6,377	777,182	0.0
Series 2019-37, Class US(d) (f)	3.61%	07/25/2049	10,122	1,135,354	0.0
Series 2019-48, Class SA(d) (f)	3.76%	12/25/2039	23,435	3,273,650	0.1
Series 2019-48, Class SM(d) (f)	3.61%	07/25/2039	8,365	1,178,097	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2014-160, Class SP(d) (f)	3.23%	10/20/2044	12,811	1,696,893	0.0
Series 2017-103, Class SL(d) (f)	3.83%	07/20/2047	15,609	1,700,713	0.0
Series 2017-134, Class SE(d) (f)	3.83%	09/20/2047	6,856	780,522	0.0
Series 2017-52, Class SN(d) (f)	3.78%	04/20/2047	4,345	474,388	0.0
				<u>94,004,780</u>	<u>0.6</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4398, Class IO(g)	6.00%	10/15/2037	12,609	2,415,187	0.0
Series 4913, Class IO(g)	6.00%	04/15/2041	5,880	1,245,527	0.0
Series 4976, Class MI(g)	4.50%	05/25/2050	32,840	6,795,973	0.1
Series 4981, Class MI(g)	5.00%	06/25/2050	46,957	9,755,300	0.1
Series 5011, Class MI(g)	3.00%	09/25/2050	14,816	2,400,132	0.0
Series 5015, Class BI(g)	4.00%	09/25/2050	20,682	3,935,492	0.0
Series 5018, Class AI(g)	4.00%	10/25/2050	10,861	2,041,321	0.0
Series 5024, Class DI(g)	4.00%	10/25/2050	5,466	964,920	0.0
Series 5030, Class EI(g)	3.50%	10/25/2050	5,255	877,307	0.0
Series 5040, Class AI(g)	3.50%	11/25/2050	2,179	367,611	0.0
Series 5043, Class IO(g)	5.00%	11/25/2050	15,128	3,292,291	0.0
Series 5052, Class IK(g)	4.00%	12/25/2050	21,981	4,002,990	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2014-37, Class AI(g)	5.50%	07/25/2044	4,320	830,468	0.0
Series 2016-26, Class IO(g)	5.00%	05/25/2046	13,644	2,294,778	0.0
Series 2016-64, Class BI(g)	5.00%	09/25/2046	23,041	3,544,319	0.0
Series 2018-54, Class IO(g)	5.50%	08/25/2048	8,014	1,703,264	0.0
Series 2020-89, Class KI(g)	4.00%	12/25/2050	75,745	14,183,983	0.1
Series 2020-96, Class KI(g)	2.50%	01/25/2051	7,322	958,165	0.0
Series 2021-18, Class IT(g)	3.00%	04/25/2051	13,503	2,173,560	0.0
				<u>63,782,588</u>	<u>0.4</u>
				<u>622,091,128</u>	<u>3.8</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB FCPI - Emerging Markets Debt Portfolio - Class SA			670,675	43,406,102	0.3
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT			3,298,026	270,636,030	1.6
AB SICAV I - Global Income Portfolio			1,073,799	86,462,297	0.5
AB SICAV I - Short Duration Income Portfolio			897,588	83,906,504	0.5
AB SICAV I - Sustainable Income Portfolio			856,251	75,255,868	0.5
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT			4,048,698	51,904,314	0.3
				<u>611,571,115</u>	<u>3.7</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	3.50%	09/01/2049	USD 4,131	\$ 3,987,943	0.0%
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	4.00%	08/01/2049	1,046	1,033,887	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	5.00%	11/01/2049	4,049	4,177,750	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2019	3.50%	10/01/2049	4,294	4,152,914	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	09/01/2049	3,167	3,132,546	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	10/01/2049	6,198	6,138,308	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2022	3.00%	09/01/2052	225,053	211,221,714	1.3
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2022	4.50%	09/01/2052	102,045	101,414,832	0.6
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2022	5.00%	09/01/2052	100,693	101,605,403	0.6
				<u>436,865,297</u>	<u>2.6</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E	4.80%	02/10/2036	12,568	11,137,355	0.1
Banc of America Commercial Mortgage Trust, Series 2015-UBS7, Class AS	3.99%	09/15/2048	2,340	2,243,008	0.0
Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust, Series 2016-UB10, Class C	5.00%	07/15/2049	2,354	2,237,947	0.0
Benchmark Mortgage Trust, Series 2019-B11, Class XA(g)	1.18%	05/15/2052	218,523	10,675,288	0.1
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(g)	1.17%	11/15/2050	6,992	238,601	0.0
CD Mortgage Trust, Series 2017-CD3, Class XA(g)	1.12%	02/10/2050	97,993	3,274,270	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust, Series 2016-C4, Class AM	3.69%	05/10/2058	390	370,562	0.0
CGMS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-B1, Class C	4.26%	08/15/2050	9,500	8,513,148	0.1
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2013-GC11, Class D	4.33%	04/10/2046	1,201	1,169,953	0.0
Series 2013-GC11, Class XA(g)	1.26%	04/10/2046	7,517	30,690	0.0
Series 2013-GC17, Class C	5.25%	11/10/2046	3,895	3,790,474	0.0
Series 2013-GC17, Class D	5.25%	11/10/2046	5,540	5,078,908	0.0
Series 2015-GC29, Class XA(g)	1.16%	04/10/2048	30,294	641,691	0.0
Series 2016-C3, Class XA(g)	1.16%	11/15/2049	161,772	5,326,440	0.0
Series 2017-P7, Class XA(g)	1.27%	04/14/2050	78,375	3,132,363	0.0
Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	8,500	4,697,100	0.0
Series 2012-CR3, Class E	4.93%	10/15/2045	2,959	1,479,419	0.0
Series 2012-CR5, Class C	4.44%	12/10/2045	620	604,724	0.0
Series 2013-CR6, Class D	4.22%	03/10/2046	2,600	2,543,791	0.0
Series 2014-CR16, Class D	5.08%	04/10/2047	12,900	11,820,013	0.1
Series 2014-LC17, Class B	4.49%	10/10/2047	3,622	3,514,666	0.0
Series 2014-UBS6, Class AM	4.05%	12/10/2047	390	378,486	0.0
Series 2015-CR27, Class XA(g)	1.06%	10/10/2048	24,470	554,718	0.0
Series 2015-LC21, Class XA(g)	0.81%	07/10/2048	71,542	1,056,668	0.0
Series 2015-PC1, Class C	4.43%	07/10/2050	11,346	10,608,756	0.1
Series 2016-DC2, Class XA(g)	1.10%	02/10/2049	1,469	36,794	0.0
Series 2017-COR2, Class XA(g)	1.31%	09/10/2050	21,514	970,806	0.0
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044	3,699	1,575,704	0.0
Series 2012-GCJ9, Class AS	3.12%	11/10/2045	10,000	9,976,744	0.1
Series 2013-GC13, Class D	4.21%	07/10/2046	17,538	7,637,799	0.1
Series 2014-GC22, Class C	4.84%	06/10/2047	993	950,684	0.0
Series 2016-GS3, Class XA(g)	1.32%	10/10/2049	113,423	4,258,621	0.0
Series 2017-GS5, Class XA(g)	0.99%	03/10/2050	135,203	4,220,003	0.0
Series 2017-GS7, Class XA(g)	1.24%	08/10/2050	80,916	3,144,754	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2013-C15, Class AS	4.42%	11/15/2045	11,115	11,005,989	0.1
Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047	9,170	8,841,215	0.1
Series 2014-C22, Class XA(g)	0.96%	09/15/2047	54,401	641,401	0.0
Series 2014-C24, Class B	4.12%	11/15/2047	1,355	1,283,956	0.0
Series 2014-C24, Class C	4.53%	11/15/2047	455	396,948	0.0
Series 2014-C26, Class C	4.52%	01/15/2048	4,926	4,636,005	0.0
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2017-C5, Class XA(g)	1.04%	03/15/2050	130,372	3,871,403	0.0
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2012-C6, Class E	5.11%	05/15/2045	5,000	3,875,000	0.0
Series 2012-LC9, Class B	3.81%	12/15/2047	2,000	1,986,246	0.0
Series 2012-LC9, Class E	4.49%	12/15/2047	10,881	9,796,743	0.1
Series 2013-C10, Class B	3.67%	12/15/2047	2,513	2,474,576	0.0
Series 2013-LC11, Class B	3.50%	04/15/2046	11,410	11,127,228	0.1
Series 2016-JP2, Class XA(g)	1.93%	08/15/2049	60,608	3,219,731	0.0
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(g)	1.69%	07/12/2050	33,229	1,817,730	0.0
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust					
Series 2013-C9, Class B	3.71%	05/15/2046	6,310	6,185,500	0.1
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	4,304	3,758,517	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2011-C3, Class C	5.25%	07/15/2049	USD 920	\$ 911,079	0.0%
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C1, Class D	6.66%	05/10/2045	1,525	1,387,875	0.0
Series 2017-C1, Class XA(g)	1.69%	06/15/2050	46,996	2,599,523	0.0
Series 2017-C2, Class XA(g)	1.13%	08/15/2050	38,041	1,542,019	0.0
Series 2017-C4, Class XA(g)	1.16%	10/15/2050	56,412	2,321,631	0.0
Series 2017-C6, Class XA(g)	1.23%	12/15/2050	37,298	1,559,510	0.0
Series 2018-C10, Class XA(g)	1.04%	05/15/2051	124,438	4,988,751	0.0
Series 2018-C15, Class XA(g)	1.15%	12/15/2051	86,436	4,084,590	0.0
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C4, Class XA(g)	1.65%	12/10/2045	986	10	0.0
Series 2013-C5, Class C	4.20%	03/10/2046	1,798	1,636,522	0.0
Series 2013-C6, Class D	4.44%	04/10/2046	8,381	7,159,669	0.1
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-C28, Class B	4.22%	05/15/2048	2,802	2,674,263	0.0
Series 2015-LC20, Class C	4.06%	04/15/2050	7,415	6,937,833	0.1
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	5,156	4,966,309	0.0
Series 2016-C32, Class XA(g)	1.37%	01/15/2059	109,982	3,641,561	0.0
Series 2016-LC24, Class XA(g)	1.75%	10/15/2049	80,505	4,050,174	0.0
Series 2016-LC25, Class XA(g)	0.98%	12/15/2059	123,136	3,406,293	0.0
Series 2017-C38, Class XA(g)	1.12%	07/15/2050	33,894	1,239,581	0.0
Series 2018-C48, Class XA(g)	1.12%	01/15/2052	11,918	541,473	0.0
WF-RBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2011-C4, Class E	4.99%	06/15/2044	8,030	6,279,174	0.1
Series 2012-C9, Class E	4.99%	11/15/2045	5,000	4,809,183	0.0
Series 2013-C11, Class B	3.71%	03/15/2045	1,758	1,743,085	0.0
Series 2013-C14, Class B	3.84%	06/15/2046	360	349,069	0.0
Series 2014-C22, Class XA(g)	0.94%	09/15/2057	39,341	467,402	0.0
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	6,846	6,624,373	0.1
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	9,035	7,899,495	0.1
Series 2014-LC14, Class C	4.34%	03/15/2047	853	823,192	0.0
				<u>287,452,775</u>	<u>1.7</u>
STAATLICHE CMBS					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates					
Series K072, Class A2	3.44%	12/25/2027	12,923	12,712,521	0.1
Series K073, Class A2	3.35%	01/25/2028	11,000	10,770,776	0.0
				<u>23,483,297</u>	<u>0.1</u>
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class D(d)					
	6.64%	05/15/2036	9,789	9,083,571	0.1
				<u>9,083,571</u>	<u>0.1</u>
				<u>320,019,643</u>	<u>1.9</u>
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATSANLEIHEN					
BAHRAIN					
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.50%	10/25/2027	25,539	25,985,933	0.2
INDONESIEN					
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030	4,342	4,242,568	0.0
KASACHSTAN					
KazMunayGas National Co. JSC	4.75%	04/24/2025	1,395	1,355,591	0.0
MEXIKO					
Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	13,131	10,269,263	0.1
Comision Federal de Electricidad	3.88%	07/26/2033	10,400	8,013,200	0.0
Comision Federal de Electricidad	4.69%	05/15/2029	20,918	18,784,364	0.1
Comision Federal de Electricidad	6.13%	06/16/2045	5,200	4,373,850	0.0
Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031	71,699	53,648,777	0.3
Petroleos Mexicanos	6.49%	01/23/2027	10,352	9,171,872	0.1
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	48,445	30,418,615	0.2
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	18,641	11,604,023	0.1
				<u>146,283,964</u>	<u>0.9</u>
PANAMA					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	4.00%	08/11/2041	9,964	8,100,732	0.1
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	5.13%	08/11/2061	8,472	6,797,721	0.0
				<u>14,898,453</u>	<u>0.1</u>
TRINIDAD & TOBAGO					
Trinidad Generation UnLtd	5.25%	11/04/2027	7,557	7,324,622	0.0
				<u>200,091,131</u>	<u>1.2</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Melco Resorts Finance Ltd.	5.38%	12/04/2029	USD 12,622	\$ 8,141,190	0.1%
Melco Resorts Finance Ltd.	5.63%	07/17/2027	9,002	6,387,482	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.25%	06/18/2025	8,970	7,530,875	0.1
MGM China Holdings Ltd.	5.38%	05/15/2024	4,527	3,983,760	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.88%	05/15/2026	4,869	4,041,270	0.0
Studio City Finance Ltd.	5.00%	01/15/2029	30,884	16,059,680	0.1
Wynn Macau Ltd.	4.88%	10/01/2024	953	762,400	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.50%	01/15/2026	30,257	23,449,175	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.50%	10/01/2027	4,203	3,026,160	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	16,758	11,730,600	0.1
				<u>85,112,592</u>	<u>0.5</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV.	4.75%	05/09/2027	25,018	21,918,895	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV.	5.13%	05/09/2029	19,409	16,859,143	0.1
				<u>38,778,038</u>	<u>0.2</u>
ENERGIE					
Leviathan Bond Ltd.	5.75%	06/30/2023	16,779	16,677,277	0.1
Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025	5,318	5,218,952	0.0
Leviathan Bond Ltd.	6.50%	06/30/2027	12,964	12,614,067	0.1
				<u>34,510,296</u>	<u>0.2</u>
				<u>158,400,926</u>	<u>0.9</u>
FINANZINSTITUTE					
VERSICHERUNGEN					
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd./Highlands Holdings Bond Co-Issuer, Inc.(b)	7.63%	10/15/2025	12,319	11,579,538	0.1
				<u>169,980,464</u>	<u>1.0</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABLE VERZINSLICH					
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class D(d)	6.41%	01/20/2034	4,250	4,002,875	0.0
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class D(d)	5.41%	04/15/2034	6,750	6,038,219	0.0
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class D(d)	5.66%	04/15/2034	4,750	4,312,368	0.0
AIG CLO Ltd., Series 2021-3A, Class D(d)	5.88%	01/25/2035	10,400	9,357,088	0.1
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class D(d)	5.36%	04/20/2034	6,000	5,464,872	0.0
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class D(d)	5.81%	10/20/2034	4,000	3,572,696	0.0
Ballyrock CLO Ltd., Series 2020-14A, Class C(d)	6.31%	01/20/2034	8,330	7,777,571	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(d)	4.52%	04/26/2031	11,000	10,452,420	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class B(d)	5.83%	07/23/2032	8,000	7,549,160	0.1
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(d)	9.04%	07/18/2030	4,717	4,261,402	0.0
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-1RA, Class D(d)	5.56%	07/15/2030	1,500	1,375,452	0.0
Elmwood CLO 15 Ltd., Series 2022-2A, Class D(d)	4.31%	04/22/2035	3,550	3,247,235	0.0
Goldentree Loan Opportunities Ltd., Series 2015-11A, Class AR2(d)	3.81%	01/18/2031	600	592,435	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(d)	5.46%	10/20/2030	6,000	5,571,534	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2019-33A, Class DR(d)	5.64%	10/16/2033	1,875	1,743,051	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2020-39A, Class D(d)	6.31%	01/20/2032	1,000	961,844	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-43A, Class D(d)	5.84%	07/17/2035	11,050	10,340,280	0.1
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class D(d)	6.06%	10/20/2034	11,950	10,722,078	0.1
Octagon Investment Partners 35 Ltd., Series 2018-1A, Class D(d)	7.91%	01/20/2031	2,750	2,418,562	0.0
Pikes Peak CLO 10, Series 2022-10A, Class D(d)	4.73%	04/22/2034	8,650	7,971,079	0.1
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class D(d)	5.81%	07/20/2034	4,000	3,612,396	0.0
Venture XXVII CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(d)	6.71%	07/20/2030	17,169	15,569,726	0.1
Whehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class D(d)	4.09%	04/21/2035	7,000	6,387,535	0.0
				<u>133,301,878</u>	<u>0.8</u>
ABS-ANLEIHEN					
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2019-2A, Class C	4.24%	09/22/2025	4,000	3,848,500	0.0
Exeter Automobile Receivables Trust, Series 2018-4A, Class E. ...	5.38%	07/15/2025	13,125	13,158,300	0.1
First Investors Auto Owner Trust, Series 2018-1A, Class E.	5.35%	07/15/2024	3,100	3,102,018	0.0
Flagship Credit Auto Trust Series 2019-1, Class E.	5.06%	06/15/2026	5,339	5,197,443	0.0
Series 2019-2, Class E.	4.52%	12/15/2026	5,677	5,516,793	0.1
Series 2019-3, Class E.	3.84%	12/15/2026	5,230	5,009,874	0.0
				<u>35,832,928</u>	<u>0.2</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust, Series 2018-P2, Class C	5.21%	10/15/2025	USD 557	\$ 554,463	0.0%
Marlette Funding Trust Series 2018-3A, Class C(d)	4.63%	09/15/2028	1,835	1,829,245	0.0
Series 2018-4A, Class C	4.91%	12/15/2028	2,569	2,564,881	0.0
				<u>4,948,589</u>	<u>0.0</u>
				<u>40,781,517</u>	<u>0.2</u>
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
BAHRAIN					
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	16,444	14,026,732	0.1
Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030	7,799	7,827,271	0.0
				<u>21,854,003</u>	<u>0.1</u>
				<u>16,080,391,836</u>	<u>97.0</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 12 Ltd. Series 2021-12A, Class D (d)	5.56%	07/20/2034	6,000	5,330,244	0.0
AGL CLO 13 Ltd. Series 2021-13A, Class D (d)	5.86%	10/20/2034	27,834	25,111,025	0.2
AGL CLO 16 Ltd. Series 2021-16A, Class D (d)	5.81%	01/20/2035	5,550	4,979,016	0.0
Apidos CLO XXIII Series 2015-23A, Class ER (d)	8.71%	04/15/2033	2,248	2,014,820	0.0
Ballyrock CLO Ltd. Series 2021-17A, Class C (d)	5.61%	07/20/2034	13,950	12,479,809	0.1
Ballyrock CLO 16 Ltd. Series 2021-16A, Class C (d)	5.76%	10/20/2034	3,000	2,660,370	0.0
CBAM Ltd. Series 2018-7A, Class B1 (d)	4.31%	07/20/2031	7,726	7,408,315	0.0
CIFC Funding Ltd. Series 2017-3A, Class A1 (d)	3.93%	07/20/2030	560	553,325	0.0
Dryden CLO Ltd. Series 2018-57A, Class A (d)	3.92%	05/15/2031	25,195	24,736,753	0.2
Greywolf CLO VI Ltd. Series 2018-1A, Class A1 (d)	1.30%	04/26/2031	22,100	21,689,780	0.1
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd. Series 2018-1A, Class A2 (d)	4.51%	07/21/2031	7,424	7,051,123	0.0
ICG US CLO Ltd. Series 2015-1A, Class CR (d)	5.84%	10/19/2028	2,500	2,353,972	0.0
Invesco CLO Ltd. Series 2021-1A, Class D (d)	5.56%	04/15/2034	8,000	7,208,848	0.0
Neub 2022-51a D Series 2022-51A, Class D (d)	8.27%	10/23/2035	9,161	9,046,240	0.1
Neuberger Berman Loan Advisors CLO Ltd. Series 2019-33A, Class CR (d)	4.64%	10/16/2033	12,000	11,266,728	0.1
Neuberger Berman Loan Advisors CLO 42 Ltd. Series 2021-42A, Class D (d)	5.54%	07/16/2035	4,000	3,657,708	0.0
Northwoods Capital XII-B Ltd. Series 2018-12BA, Class B (d)	3.68%	06/15/2031	5,400	5,137,884	0.0
Octagon Investment Partners 38 Ltd. Series 2018-1A, Class B (d)	4.66%	07/20/2030	3,900	3,674,993	0.0
OZLM Ltd. Series 2014-7RA, Class BR (d)	4.94%	07/17/2029	9,000	8,606,898	0.1
OZLM VII Ltd. Series 2014-7RA, Class CR (d)	5.74%	07/17/2029	10,500	9,835,434	0.1
OZLM XVIII Ltd. Series 2018-18A, Class A (d)	3.53%	04/15/2031	9,625	9,439,488	0.1
OZLM XVIII Ltd. Series 2018-18A, Class B (d)	4.06%	04/15/2031	3,000	2,843,826	0.0
Peace Park CLO Ltd. Series 2021-1A, Class D (d)	5.66%	10/20/2034	27,675	25,699,974	0.2
PPM CLO 5 Ltd. Series 2021-5A, Class D (d)	5.79%	10/18/2034	16,000	14,050,928	0.1
Sound Point CLO XIX Ltd. Series 2018-1A, Class A (d)	3.51%	04/15/2031	34,104	33,414,826	0.2
Speak Series 2022-12A, Class D (d)	6.94%	07/18/2034	4,550	4,318,296	0.0
THL Credit Wind River CLO Ltd. Series 2017-4A, Class A (d)	4.13%	11/20/2030	6,898	6,805,625	0.0
TICP CLO IX Ltd. Series 2017-9A, Class B (d)	4.31%	01/20/2031	1,550	1,504,549	0.0
Venture XXIX CLO Ltd. Series 2017-29A, Class C (d)	5.41%	09/07/2030	2,300	2,160,655	0.0
Voya CLO Ltd. Series 2016-3A, Class AIR (d)	3.93%	10/18/2031	3,000	2,953,584	0.0
Voya CLO Ltd. Series 2016-3A, Class BR (d)	4.94%	10/18/2031	10,000	9,303,700	0.1
				<u>287,298,736</u>	<u>1.7</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4933, Class IO(g)	5.00%	03/15/2049	7,352	1,198,634	0.0
Series 4987, Class IC(g)	4.50%	06/25/2050	112,432	19,316,886	0.1
Series 4993, Class LI(g)	5.00%	07/25/2050	13,613	2,192,606	0.0
Series 5008, Class AI(g)	3.50%	09/25/2050	15,090	2,463,340	0.0
Series 5013, Class JI(g)	4.00%	09/25/2050	25,465	3,868,299	0.0
Series 5018, Class GI(g)	4.50%	10/25/2050	17,390	3,186,621	0.0
Series 5036, Class IT(g)	4.00%	03/25/2050	7,015	1,273,666	0.0
Series 5049, Class CI(g)	3.50%	12/25/2050	24,506	4,376,195	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2010-109, Class IM(g)	5.50%	09/25/2040	2,138	353,392	0.0
Series 2015-22, Class EI(g)	6.00%	04/25/2045	18,987	3,491,116	0.0
Series 2016-11, Class GI(g)	5.00%	03/25/2046	3,869	700,740	0.0
Series 2016-33, Class NI(g)	5.00%	07/25/2034	16,109	2,883,191	0.0
Series 2016-34, Class AI(g)	5.00%	06/25/2046	14,114	2,288,872	0.0
Series 2016-37, Class BI(g)	5.00%	06/25/2046	25,300	4,353,055	0.1
Government National Mortgage Association					
Series 2015-62, Class GI(g)	6.50%	05/20/2045	15,523	2,943,674	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2019-57, Class IO(g)	5.50%	05/20/2049	USD 4,848	\$ 870,150	0.0%
				<u>55,760,437</u>	<u>0.3</u>
VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 3725, Class CS(d) (f)	3.61%	05/15/2040	20,946	1,700,089	0.0
Series 4292, Class S(d) (f)	3.66%	01/15/2044	2,563	335,860	0.0
Series 4317, Class SD(d) (f)	4.81%	08/15/2035	6,267	932,226	0.0
Series 4372, Class JS(d) (f)	3.71%	08/15/2044	15,279	1,793,371	0.0
Series 4373, Class SA(d) (f)	3.76%	08/15/2044	9,581	1,201,101	0.0
Series 4570, Class ST(d) (f)	3.61%	04/15/2046	8,428	1,064,013	0.0
Series 4593, Class SA(d) (f)	3.61%	06/15/2046	10,894	1,318,649	0.0
Series 4719, Class SA(d) (f)	3.76%	09/15/2047	8,431	1,165,657	0.0
Series 4735, Class SA(d) (f)	3.81%	12/15/2047	25,000	3,269,637	0.1
Series 4736, Class LS(d) (f)	3.81%	12/15/2047	11,189	1,610,517	0.0
Series 4736, Class SM(d) (f)	3.81%	12/15/2047	22,427	3,016,519	0.1
Series 4927, Class SJ(d) (f)	3.61%	11/25/2049	15,810	2,578,288	0.0
Series 4981, Class JS(d) (f)	3.66%	06/25/2050	112,645	16,398,209	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2006-8, Class JH(d) (f)	4.16%	03/25/2036	8,684	1,151,834	0.0
Series 2012-17, Class ES(d) (f)	4.11%	03/25/2041	1,276	58,696	0.0
Series 2013-62, Class SA(d) (f)	4.26%	06/25/2043	10,823	1,816,932	0.0
Series 2014-35, Class CS(d) (f)	3.71%	06/25/2044	11,848	1,115,792	0.0
Series 2015-57, Class AS(d) (f)	3.81%	08/25/2045	43,877	4,092,690	0.1
Series 2016-60, Class SA(d) (f)	3.66%	09/25/2046	25,392	2,379,335	0.0
Series 2016-65, Class AS(d) (f)	3.66%	09/25/2046	11,364	1,252,127	0.0
Series 2017-49, Class SP(d) (f)	3.71%	07/25/2047	7,240	937,940	0.0
Series 2017-81, Class CS(d) (f)	3.76%	10/25/2047	7,797	1,292,140	0.0
Series 2017-85, Class HS(d) (f)	3.76%	11/25/2047	12,950	1,639,100	0.0
Series 2017-109, Class SJ(d) (f)	3.76%	01/25/2048	3,204	447,952	0.0
Series 2018-13, Class SG(d) (f)	3.71%	03/25/2048	7,143	1,029,854	0.0
Series 2018-39, Class AS(d) (f)	3.76%	06/25/2048	6,469	1,090,114	0.0
Series 2018-47, Class SD(d) (f)	3.76%	07/25/2048	20,922	2,903,001	0.1
Series 2018-63, Class KS(d) (f)	3.76%	09/25/2048	5,655	767,323	0.0
Series 2019-38, Class SM(d) (f)	3.61%	07/25/2049	6,203	1,076,929	0.0
Series 2019-42, Class SQ(d) (f)	3.61%	08/25/2049	18,118	2,546,236	0.0
Series 2019-60, Class SJ(d) (f)	3.61%	10/25/2049	19,225	2,622,606	0.0
Series 2019-65, Class SY(d) (f)	3.61%	11/25/2049	12,987	1,933,340	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2017-115, Class SA(d) (f)	3.83%	07/20/2047	12,237	1,382,536	0.0
Series 2017-122, Class SA(d) (f)	3.83%	08/20/2047	15,250	1,842,514	0.0
Series 2017-149, Class SG(d) (f)	3.83%	10/20/2047	11,485	1,336,959	0.0
Series 2020-47, Class SG(d) (f)	3.63%	02/20/2049	14,600	1,430,648	0.0
				<u>72,530,734</u>	<u>0.5</u>
RISIKOTEILUNG – VARIABLE VERZINSLICH					
JPMorgan Madison Avenue Securities Trust,					
Series 2015-CH1, Class M2(d)	7.94%	10/25/2025	450	438,877	0.0
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2020-1R, Class A(d)					
	4.84%	02/27/2023	12,343	12,195,504	0.1
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust,					
Series 2015-WF1, Class 1M2(d)	7.69%	11/25/2025	534	489,618	0.0
				<u>13,123,999</u>	<u>0.1</u>
				<u>141,415,170</u>	<u>0.9</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Citigroup Commercial Mortgage Trust, Series 2016-P3,					
Class XA(g)	1.82%	04/15/2049	110,808	4,801,657	0.1
Commercial Mortgage Trust					
Series 2014-CR15, Class XA(g)	0.77%	02/10/2047	6,299	45,297	0.0
Series 2012-CR3, Class D	4.93%	10/15/2045	3,971	3,097,380	0.0
Grantor Trust CGCMT, Series 2015-P1X(h)	4.49%	09/15/2048	105	5,073,287	0.1
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(h)	0.00%	10/03/2047	143	4,675,194	0.0
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(h)	4.00%	04/15/2050	207	5,428,207	0.1
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(h)	4.00%	11/15/2047	222	2,851,223	0.0
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(h)	3.40%	10/15/2057	125	4,318,514	0.0
GS Mortgage Securities Corp. II, Series 2013-GC10, Class XA(g)	1.60%	02/10/2046	27,641	46,960	0.0
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2013-GC13, Class E(h)	3.49%	07/10/2046	112	3,090,531	0.0
Series 2013-GC13, Class E(h)(i)	3.49%	07/10/2046	119	4,622,432	0.0
Series 2013-GC13, Class F(h)	3.49%	07/10/2046	50	899,883	0.0
Series 2013-GC13, Class F(h)(i)	3.49%	07/10/2046	30	1,678,736	0.0
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, Series 2015-LC20,					
Class XA(g)	1.43%	04/15/2050	31,905	752,450	0.0
WF-RBS Commercial Mortgage Trust, Series 2012-C7, Class E					
	4.81%	06/15/2045	8,500	765,000	0.0
				<u>42,146,751</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
Starwood Retail Property Trust, Series 2014-STAR, Class A(d) . . .	3.86%	11/15/2027	USD 36,183	\$ 24,785,449	0.1%
				<u>24,785,449</u>	<u>0.1</u>
				<u>66,932,200</u>	<u>0.4</u>
STAMMAKTIEN					
Mt. Logan Re Ltd.(h)			10,878	<u>9,709,449</u>	<u>0.1</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV	7.75%	05/15/2023	USD 7,651	<u>7,770,807</u>	<u>0.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
INVESTITIONSGÜTER					
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	19,218	<u>124,916</u>	<u>0.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Virgolino de Oliveira Finance SA (h) (j)	10.50%	01/28/2018	3,700	370	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA (h) (j)	11.75%	02/09/2022	31,238	3,124	0.0
Tonon Luxembourg SA (b) (e) (h)	6.50%	10/31/2024	4,600	460	0.0
				<u>3,954</u>	<u>0.0</u>
VERSORGBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Chile Electricity PEC SpA	0.00%	01/25/2028	5,495	3,794,984	0.0
Terraform Global Operating LLC	6.12%	03/01/2026	7,314	7,011,720	0.1
				<u>10,806,704</u>	<u>0.1</u>
				<u>10,810,658</u>	<u>0.1</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
State of California, Series 2010	7.60%	11/01/2040	1,600	2,160,052	0.0
State of Illinois, Series 2010	7.35%	07/01/2035	7,675	8,422,652	0.1
Wisconsin Public Finance Authority, Series 2021	5.75%	07/25/2041	15,000	14,174,052	0.1
				<u>24,756,756</u>	<u>0.2</u>
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATSANLEIHEN					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC(e)	7.63%	11/08/2026	14,994	2,959,441	0.0
State Agency of Roads of Ukraine	6.25%	06/24/2030	22,184	3,865,562	0.0
				<u>6,825,003</u>	<u>0.0</u>
				<u>555,643,695</u>	<u>3.4</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$19,445,149,128)				<u>\$ 16,636,035,531</u>	<u>100.4%</u>
Termineinlagen					
ANZ, London(k)	0.80 %	–		27,004	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(k)	1.37 %	–		5,294	0.0
BBH, Grand Cayman(k)	1.65 %	–		4,497	0.0
BBH, Grand Cayman(k)	4.15 %	–		210,113	0.0
BNP Paribas, Paris(k)	(0.34)%	–		58	0.0
BNP Paribas, Paris(k)	0.40 %	–		1,743,554	0.0
BNP Paribas, Paris(k)	1.10 %	–		949	0.0
DBS Bank Ltd, Singapore(k)	1.68 %	–		272,306,421	1.6
HSBC Bank PLC, Paris(k)	(0.13)%	–		12,002,310	0.1
Sumitomo, London(k)	0.87 %	–		33,960	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>286,334,160</u>	<u>1.7</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(355,653,606)</u>	<u>(2.1)</u>
Nettovermögen				<u>\$ 16,566,716,085</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
U.S. Long Bond (CBT) Futures	12/20/2022	2,437	\$ 334,519,648	\$ 331,051,219	\$ (3,468,429)
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	12/30/2022	7,823	1,629,746,398	1,629,750,930	4,532
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	12/30/2022	4,352	483,828,773	482,290,002	(1,538,771)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	12/20/2022	15,119	1,781,865,414	1,767,505,594	(14,359,820)
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	12/20/2022	2,710	408,564,508	405,145,000	(3,419,508)

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Future	12/20/2022	4,709	\$ 592,375,781	\$ 589,507,938	\$ 2,867,843
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures+	12/20/2022	68	7,998,844	7,949,625	49,219
					<u>\$ (19,864,934)</u>
				Wertsteigerung	\$ 2,921,594
				Wertminderung	\$ (22,786,528)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	AUD 1,720,853	USD 1,202,271	09/06/2022	\$ 24,713,524
Brown Brothers Harriman & Co.+.	CAD 320,765	USD 249,754	09/06/2022	5,522,090
Brown Brothers Harriman & Co.+.	CNH 11,370	USD 1,663	09/06/2022	13,090
Brown Brothers Harriman & Co.+.	EUR 239,468	USD 245,103	09/06/2022	4,387,210
Brown Brothers Harriman & Co.+.	EUR 1,384	USD 1,384	09/06/2022	(7,082)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	GBP 355,545	USD 432,003	09/06/2022	18,936,422
Brown Brothers Harriman & Co.+.	PLN 197,256	USD 42,820	09/06/2022	871,841
Brown Brothers Harriman & Co.+.	PLN 2,453	USD 515	09/06/2022	(7,001)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	SGD 621,561	USD 451,289	09/06/2022	6,504,060
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 1,590,970	AUD 2,286,051	09/06/2022	(26,655,317)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 332,976	CAD 428,933	09/06/2022	(6,385,258)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 139	CNH 960	09/06/2022	529
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 48,325	CNH 326,692	09/06/2022	(932,150)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 90,301	EUR 89,858	09/06/2022	25,496
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 240,262	EUR 234,651	09/06/2022	(4,387,913)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 573,981	GBP 475,542	09/06/2022	(21,504,406)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 13,838	PLN 65,563	09/06/2022	104,092
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 42,820	PLN 197,256	09/06/2022	(871,841)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 235	SGD 329	09/06/2022	22
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 599,491	SGD 827,767	09/06/2022	(7,145,469)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 124,968	ZAR 2,088,938	09/06/2022	(3,051,936)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	ZAR 1,572,420	USD 94,676	09/06/2022	2,905,434
Brown Brothers Harriman & Co.+.	CAD 127,165	USD 99,123	09/12/2022	2,302,454
Brown Brothers Harriman & Co.+.	CHF 45,583	USD 48,337	09/12/2022	1,669,586
Brown Brothers Harriman & Co.+.	EUR 219,197	USD 225,506	09/12/2022	5,078,657
Brown Brothers Harriman & Co.+.	EUR 1,665	USD 1,667	09/12/2022	(7,089)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	JPY 5,733,736	USD 43,079	09/12/2022	1,776,363
Brown Brothers Harriman & Co.+.	NZD 464,098	USD 295,375	09/12/2022	11,435,004
Brown Brothers Harriman & Co.+.	SGD 508,403	USD 370,230	09/12/2022	6,411,463
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 131,144	CAD 168,793	09/12/2022	(2,629,028)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 63,344	CHF 59,945	09/12/2022	(1,972,034)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 83,856	EUR 83,412	09/12/2022	24,692
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 220,663	EUR 214,380	09/12/2022	(5,079,318)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 56,991	JPY 7,633,842	09/12/2022	(2,000,881)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 395,075	NZD 625,641	09/12/2022	(12,302,337)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 235	SGD 329	09/12/2022	24
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 491,326	SGD 676,891	09/12/2022	(6,936,568)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 242,136	ZAR 4,008,163	09/12/2022	(8,333,599)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	ZAR 3,010,726	USD 183,681	09/12/2022	8,060,677
Brown Brothers Harriman & Co.+.	AUD 1,428,565	USD 991,186	09/19/2022	13,424,780
Brown Brothers Harriman & Co.+.	CAD 216,793	USD 167,879	09/19/2022	2,830,061
Brown Brothers Harriman & Co.+.	CNH 9,734	USD 1,421	09/19/2022	8,435
Brown Brothers Harriman & Co.+.	GBP 234,246	USD 282,683	09/19/2022	10,470,729
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 1,475,248	AUD 2,132,323	09/19/2022	(15,809,043)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 252,409	CAD 326,676	09/19/2022	(3,702,803)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 139	CNH 960	09/19/2022	536
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 47,502	CNH 322,358	09/19/2022	(732,331)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD 421,821	GBP 351,819	09/19/2022	(12,980,096)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	EUR 174	USD 175	10/03/2022	(9)
				<u>\$ (15,956,238)</u>
			Wertsteigerung	\$ 127,477,271
			Wertminderung	\$ (143,433,509)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 3,145	\$ (342,828)	\$ (296,894)
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 38, 5 Year Index	06/20/2027	1,865,299	(22,860,428)	(80,231,766)
Goldman Sachs International/(INTRCONX)	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	2,611	(284,548)	(246,422)
Insgesamt				<u>\$ (23,487,804)</u>	<u>\$ (80,775,082)</u>

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	\$ 2,451,976
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	USD 58,460	06/28/2026	1.460%	3 Month LIBOR	4,189,033
Insgesamt					<u>\$ 6,641,009</u>

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte						
Barclays Bank PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,858	\$ (1,617,400)	\$ (72,867)	\$ (1,544,533)
Barclays Bank PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	18,329	(3,988,310)	(266,777)	(3,721,533)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	315	(34,283)	177	(34,460)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	6,290	(685,657)	(107,535)	(578,122)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	6,290	(685,657)	(116,384)	(569,273)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	12,581	(1,371,314)	(240,187)	(1,131,127)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,255	(525,978)	(227,340)	(298,638)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,510	(1,052,280)	(446,944)	(605,336)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,510	(1,052,280)	(456,278)	(596,002)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,510	(1,052,280)	(458,435)	(593,845)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,601	(1,509,681)	(414,857)	(1,094,824)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(550,051)	(1,067,349)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(624,840)	(992,560)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(72,910)	(1,544,490)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(80,051)	(1,537,349)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(80,051)	(1,537,349)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(74,669)	(1,542,731)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,173	(2,587,840)	(1,139,026)	(1,448,814)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	188	(41,000)	(21,678)	(19,322)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	228	(49,615)	(13,200)	(36,415)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	268	(58,389)	(30,757)	(27,632)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	616	(134,007)	(76,243)	(57,764)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,417	(308,376)	(83,317)	(225,059)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,466	(319,065)	(138,269)	(180,796)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(210,168)	(587,494)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(1,034,940)	237,278
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(1,111,018)	313,356
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(298,528)	(499,134)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,399	(957,194)	(338,952)	(618,242)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,897	(1,065,517)	(1,213,726)	(148,209)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,103	(1,545,709)	(411,222)	(1,134,487)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(2,103,537)	(508,213)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(2,086,840)	(491,516)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(414,620)	(1,180,704)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(431,026)	(1,164,298)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(590,060)	(1,005,264)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(698,142)	(897,182)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(699,912)	(895,412)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(689,732)	(905,592)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(685,081)	(910,243)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,182	(1,997,984)	(2,106,779)	(108,795)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,182	(1,997,984)	(2,085,711)	(87,727)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,997	(2,392,986)	(951,047)	(1,441,939)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,997	(2,392,986)	(1,468,681)	(924,305)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,997	(2,392,986)	(843,001)	(1,549,985)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 12,242	\$ (2,663,872)	\$ (2,780,837)	\$ 116,965
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	12,974	(2,823,205)	(747,793)	(2,075,412)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	13,246	(2,882,272)	(778,734)	(2,103,538)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	14,177	(3,084,878)	(1,151,980)	(1,932,898)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	18,329	(3,988,310)	(325,628)	(3,662,682)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	21,994	(4,785,972)	(1,704,512)	(3,081,460)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	1,558	(169,837)	(58,349)	(111,488)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	2,290	(249,579)	(88,695)	(160,884)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	2,809	(306,146)	(103,614)	(202,532)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,053	(332,749)	(116,594)	(216,155)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,117	(339,743)	(118,935)	(220,808)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	6,353	(692,513)	(62,998)	(629,515)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	7,792	(849,323)	(291,791)	(557,532)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,472	(1,455,660)	(309,215)	(1,146,445)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(69,309)	(1,548,091)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,331	(3,073,060)	(677,236)	(2,395,824)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,717	(3,234,800)	(149,338)	(3,085,462)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,716	(373,306)	(20,571)	(352,735)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	1,573	(171,414)	884	(172,298)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,145	(342,828)	(60,047)	(282,781)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,145	(342,828)	(115,665)	(227,163)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,523	(1,057,456)	(465,818)	(591,638)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	32,796	(13,747,898)	(5,956,008)	(7,791,890)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	233	(50,731)	(22,577)	(28,154)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,993	(651,211)	(289,809)	(361,402)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,049	(663,495)	(199,531)	(463,964)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,145	(684,394)	(208,988)	(475,406)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(482,642)	(315,020)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(465,589)	(332,073)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(952,442)	(642,882)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(529,725)	(1,065,599)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,178	(1,779,424)	(548,428)	(1,230,996)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,285	(1,802,716)	(831,282)	(971,434)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,100	(2,197,718)	(1,127,753)	(1,069,965)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	14,242	(3,099,076)	(963,866)	(2,135,210)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	14,663	(3,190,648)	(875,085)	(2,315,563)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,145	(342,828)	(28,424)	(314,404)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,145	(342,828)	(32,180)	(310,648)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,145	(342,828)	(64,459)	(278,369)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	4,430	(482,840)	(167,580)	(315,260)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,210	(567,930)	(105,973)	(461,957)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	6,290	(685,657)	(251,023)	(434,634)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	6,290	(685,656)	(226,947)	(458,709)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	15,726	(1,714,142)	(538,437)	(1,175,705)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	289	(120,982)	(53,250)	(67,732)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,553	(650,842)	(284,661)	(366,181)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,505	(1,050,016)	(453,481)	(596,535)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,505	(1,050,016)	(455,294)	(594,722)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(553,469)	(1,063,931)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(556,848)	(1,060,552)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,402	(2,264,360)	(680,812)	(1,583,548)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,623	(4,033,795)	(1,727,601)	(2,306,194)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	10,015	(4,198,446)	(1,786,256)	(2,412,190)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,566	(558,363)	(261,108)	(297,255)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(300,919)	(496,743)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(326,852)	(470,810)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(345,673)	(451,989)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(374,360)	(423,302)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(373,910)	(423,752)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(458,772)	(338,890)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(522,868)	(274,794)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(390,148)	(407,514)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,730	(1,029,303)	(585,619)	(443,684)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,765	(1,036,961)	(487,252)	(549,709)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(709,653)	(885,671)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(1,037,123)	(558,201)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(1,061,382)	(533,942)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(1,043,310)	(552,014)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(1,045,735)	(549,589)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(844,034)	(751,290)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,436	(2,053,182)	(614,518)	(1,438,664)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,997	(2,392,986)	(631,725)	(1,761,261)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	21,994	(4,785,972)	(1,790,380)	(2,995,592)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	205	(22,307)	(7,941)	(14,366)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	6,290	\$ (685,656)	\$ (116,384)	\$ (569,272)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,800	(754,678)	(208,701)	(545,977)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(67,521)	(1,549,879)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(70,980)	(1,546,420)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,858	(1,617,400)	(63,681)	(1,553,719)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,717	(3,234,800)	(142,108)	(3,092,692)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,717	(3,234,800)	(145,592)	(3,089,208)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,666	(797,662)	(482,642)	(315,020)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,787	(1,041,587)	(307,875)	(733,712)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,645	(1,228,399)	(692,396)	(536,003)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(106,356)	(1,488,968)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,331	(1,595,324)	(74,047)	(1,521,277)
Insgesamt				<u>\$ (195,180,866)</u>	<u>\$ (73,573,972)</u>	<u>\$ (121,606,894)</u>
					Wertsteigerung	\$ 2,012,059
					Wertminderung	\$ (123,618,953)

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#	\$ 12,111,695
Swaps insgesamt					<u>\$ (183,629,272)</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 31. August 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) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 31. August 2022.
- (j) Notleidendes fälliges Wertpapier.
- (k) 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

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy	3.63%	02/04/2028	EUR 4,149	€ 3,410,481	0.2%
Ashland Services BV	2.00%	01/30/2028	2,143	1,822,024	0.1
Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV	3.75%	01/15/2025	2,249	2,126,473	0.2
Constellium SE	3.13%	07/15/2029	2,810	2,177,171	0.2
Guala Closures SpA	3.25%	06/15/2028	2,690	2,268,027	0.2
Huhtamaki Oyj	4.25%	06/09/2027	3,500	3,403,382	0.2
INEOS Quattro Finance 1 PLC	3.75%	07/15/2026	4,128	3,525,391	0.3
Monitchem HoldCo 3 SA	5.25%	03/15/2025	2,636	2,479,974	0.2
Rimini Bidco SpA(a)	5.25%	12/14/2026	6,960	5,985,362	0.4
Schoeller Packaging BV	6.38%	11/01/2024	7,446	6,134,997	0.4
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	4.38%	11/01/2026	3,900	3,241,001	0.2
SGL Carbon SE	4.63%	09/30/2024	2,015	1,908,982	0.1
Solvay Finance SACA(b)	5.87%	06/03/2024	4,300	4,312,845	0.3
Synthomer PLC	3.88%	07/01/2025	3,200	2,965,570	0.2
				<u>45,761,680</u>	<u>3.2</u>
INVESTITIONSGÜTER					
ARD Finance SA(c)	5.00%	06/30/2027	8,223	6,086,342	0.4
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance PLC	3.00%	09/01/2029	4,391	3,441,446	0.3
Ctec II GmbH	5.25%	02/15/2030	10,308	7,667,457	0.6
IMA Industria Macchine Automatiche SpA	3.75%	01/15/2028	2,100	1,728,668	0.1
Paprec Holding SA	4.00%	03/31/2025	4,884	4,549,445	0.3
PCF GmbH	4.75%	04/15/2026	5,410	4,484,951	0.3
Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025	10,278	9,640,163	0.7
Titan Holdings II BV	5.13%	07/15/2029	10,000	8,504,168	0.6
TK Elevator Holdco GmbH	6.63%	07/15/2028	6,436	5,531,612	0.4
TK Elevator Midco GmbH	4.38%	07/15/2027	1,868	1,644,621	0.1
Trivium Packaging Finance BV	3.75%	08/15/2026	8,834	8,354,100	0.6
				<u>61,632,973</u>	<u>4.4</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Altice Finco SA	4.75%	01/15/2028	6,500	5,138,705	0.4
Banjay Entertainment SASU	3.50%	03/01/2025	5,108	4,741,577	0.3
Banjay Group SAS	6.50%	03/01/2026	776	698,974	0.1
Summer BC Holdco A SARL	9.25%	10/31/2027	1,748	1,507,743	0.1
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	3,445	3,187,907	0.2
Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC	4.88%	07/15/2028	GBP 7,199	7,056,549	0.5
Ziggo Bond Co. BV	3.38%	02/28/2030	EUR 5,350	4,038,271	0.3
				<u>26,369,726</u>	<u>1.9</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France SA/France	5.88%	02/01/2027	4,635	4,205,337	0.3
eircom Finance DAC	3.50%	05/15/2026	5,600	5,171,210	0.4
Iliad Holading SASU	5.13%	10/15/2026	3,650	3,456,117	0.3
Kaixo Bondco Telecom SA	5.13%	09/30/2029	3,462	2,818,818	0.2
Lorca Telecom Bondco SA	4.00%	09/18/2027	7,898	7,061,414	0.5
Telecom Italia SpA/Milano	4.00%	04/11/2024	4,881	4,834,352	0.3
Telefonica Europe BV(b)	4.38%	12/14/2024	9,400	9,020,707	0.6
Telefonica Europe BV(b)	5.88%	03/31/2024	7,100	7,123,249	0.5
United Group BV	3.13%	02/15/2026	2,110	1,731,656	0.1
United Group BV	4.00%	11/15/2027	3,540	2,863,510	0.2
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.00%	01/31/2029	GBP 8,900	8,689,549	0.6
Vodafone Group PLC	4.88%	10/03/2078	7,600	8,150,063	0.6
				<u>65,125,982</u>	<u>4.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Adient Global Holdings Ltd.	3.50%	08/15/2024	EUR 2,730	2,542,760	0.2
Dana Financing Luxembourg SARL	3.00%	07/15/2029	3,060	2,343,880	0.2
Faurecia SE	2.75%	02/15/2027	4,000	3,281,857	0.2
Ford Motor Credit Co. LLC	4.54%	03/06/2025	GBP 6,650	7,300,773	0.5
Goodyear Europe BV	2.75%	08/15/2028	EUR 3,000	2,409,200	0.2
IHO Verwaltungs GmbH(c)	3.63%	05/15/2025	4,081	3,744,337	0.2
IHO Verwaltungs GmbH(c)	3.75%	09/15/2026	6,498	5,699,787	0.4
Jaguar Land Rover Automotive PLC	4.50%	07/15/2028	1,951	1,404,720	0.1
Schaeffler AG	3.38%	10/12/2028	7,600	6,574,610	0.5
ZF Finance GmbH	3.75%	09/21/2028	1,900	1,542,246	0.1
				<u>36,844,170</u>	<u>2.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	7.63%	03/01/2026	2,610	2,214,779	0.2
CPUK Finance Ltd.	4.50%	08/28/2027	GBP 4,577	4,724,569	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettovermögen %
CPUK Finance Ltd.	4.88%	08/28/2025	GBP 3,550	€ 3,832,147	0.3%
Deuce Finco PLC(a)	4.75%	06/15/2027	EUR 4,100	3,668,845	0.3
Motion Bondco DAC.	4.50%	11/15/2027	5,820	4,667,146	0.3
				<u>19,107,486</u>	<u>1.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Accor SA(b)	2.63%	01/30/2025	5,300	4,432,306	0.3
Allwyn Entertainment Financing UK PLC(a)	4.45%	02/15/2028	6,142	5,840,831	0.4
Castle Uk Finco PLC(a)	5.57%	05/15/2028	5,826	5,005,841	0.4
Castle Uk Finco PLC	7.00%	05/15/2029	GBP 1,870	1,731,643	0.1
Cirsa Finance International SARL.	4.75%	05/22/2025	EUR 1,840	1,699,555	0.1
International Game Technology PLC	2.38%	04/15/2028	3,820	3,197,222	0.2
LHMC Finco 2 SARL(c)	7.25%	10/02/2025	7,482	6,329,388	0.5
NH Hotel Group SA.	4.00%	07/02/2026	3,230	2,990,315	0.2
Standard Industries, Inc./NJ.	2.25%	11/21/2026	1,900	1,594,952	0.1
				<u>32,822,053</u>	<u>2.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
Punch Finance PLC	6.13%	06/30/2026	GBP 2,800	2,822,267	0.2
Stonegate Pub Co. Financing 2019 PLC.	8.00%	07/13/2025	4,430	4,680,152	0.3
				<u>7,502,419</u>	<u>0.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
BK LC Lux Finco1 SARL	5.25%	04/30/2029	EUR 7,510	6,443,974	0.4
Marks & Spencer PLC(d)	4.50%	07/10/2027	GBP 5,100	5,079,107	0.4
Maxeda DIY Holding BV	5.88%	10/01/2026	EUR 3,290	2,372,245	0.2
Shiba Bidco SpA	4.50%	10/31/2028	7,529	6,372,363	0.4
				<u>20,267,689</u>	<u>1.4</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Cab Selas	3.38%	02/01/2028	3,830	3,198,050	0.2
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027	10,398	9,317,902	0.7
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	4.38%	01/15/2028	3,897	3,516,793	0.2
Chrome Holdco SASU.	5.00%	05/31/2029	5,920	4,698,618	0.3
Grifols Escrow Issuer SA.	3.88%	10/15/2028	9,737	7,785,192	0.5
Gruenthal GmbH	4.13%	05/15/2028	7,278	6,665,489	0.5
Iceland Bondco PLC	4.38%	05/15/2028	GBP 4,300	3,185,873	0.2
IQVIA, Inc.	2.25%	03/15/2029	EUR 2,940	2,440,200	0.2
Nidda BondCo GmbH	7.25%	09/30/2025	3,860	3,430,553	0.2
Nobel Bidco BV.	3.13%	06/15/2028	2,499	1,764,157	0.1
Nomad Foods Bondco PLC.	2.50%	06/24/2028	2,820	2,337,306	0.2
Picard Bondco SA	5.38%	07/01/2027	4,423	3,586,320	0.3
Premier Foods Finance PLC	3.50%	10/15/2026	GBP 1,600	1,636,041	0.1
Primo Water Holdings, Inc.	3.88%	10/31/2028	EUR 2,770	2,368,225	0.2
Quatrim SASU.	5.88%	01/15/2024	3,965	3,631,873	0.3
Rossini SARL	6.75%	10/30/2025	3,780	3,780,399	0.3
				<u>63,342,991</u>	<u>4.5</u>
ENERGIE					
Cullinan Holdco Scsp(a)	4.75%	10/15/2026	4,535	3,835,277	0.3
Repsol International Finance BV.	4.50%	03/25/2025	2,612	2,571,703	0.2
				<u>6,406,980</u>	<u>0.5</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2027	4,491	4,066,309	0.3
Paganini Bidco SpA.	4.52%	10/30/2028	3,450	3,213,611	0.2
SIG PLC.	5.25%	11/30/2026	6,954	5,792,596	0.4
				<u>13,072,516</u>	<u>0.9</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./					
Atlas Luxco 4 SARL	4.88%	06/01/2028	GBP 3,214	2,980,498	0.2
APCOA Parking Holdings GmbH	4.63%	01/15/2027	EUR 6,715	5,501,403	0.4
Aramark International Finance SARL.	3.13%	04/01/2025	1,926	1,784,993	0.1
Arena Luxembourg Finance SARL.	1.88%	02/01/2028	2,000	1,537,267	0.1
Elior Group SA	3.75%	07/15/2026	1,982	1,673,104	0.1
Elis SA	4.13%	05/24/2027	2,200	2,118,907	0.2
La Financiere Atalian SASU	6.63%	05/15/2025	GBP 3,825	4,230,436	0.3
Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH.	6.00%	07/30/2026	EUR 4,355	4,055,207	0.3
Verisure Midholding AB	5.25%	02/15/2029	5,233	4,218,832	0.3
				<u>28,100,647</u>	<u>2.0</u>
TECHNOLOGIE					
Boxer Parent Co., Inc.	6.50%	10/02/2025	7,756	7,537,371	0.5
Cedacri Mergeco SpA	4.95%	05/15/2028	7,968	7,630,684	0.5
Centurion Bidco SpA.	5.88%	09/30/2026	10,100	9,355,464	0.7
Infineon Technologies AG(b)	3.63%	01/01/2028	4,500	4,059,362	0.3
Playtech PLC	4.25%	03/07/2026	5,253	4,951,740	0.4
TeamSystem SpA.	3.50%	02/15/2028	6,147	5,347,315	0.4
				<u>38,881,936</u>	<u>2.8</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	5.25%	10/15/2026	EUR 2,648	€ 2,354,533	0.2%
Avis Budget Finance PLC	4.75%	01/30/2026	2,738	2,555,431	0.2
BCP V Modular Services Finance II PLC	6.13%	11/30/2028	GBP 4,720	4,413,468	0.3
BCP V Modular Services Finance PLC	6.75%	11/30/2029	EUR 3,954	2,958,263	0.2
Gatwick Airport Finance PLC	4.38%	04/07/2026	GBP 5,600	5,789,885	0.4
Kapla Holding SAS	3.38%	12/15/2026	EUR 6,222	5,409,954	0.4
Loxam SAS	3.75%	07/15/2026	3,237	2,928,623	0.2
Loxam SAS	4.50%	02/15/2027	741	672,170	0.0
Loxam SAS	6.00%	04/15/2025	4,917	4,614,033	0.3
				<u>31,696,360</u>	<u>2.2</u>
				<u>496,935,608</u>	<u>35.2</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Banco de Credito Social Cooperativo SA	5.25%	11/27/2031	2,200	1,838,472	0.1
Banco de Sabadell SA(b)	5.00%	05/19/2027	3,000	2,294,482	0.2
Banco de Sabadell SA, Series E	5.63%	05/06/2026	7,100	7,190,191	0.5
Banco Santander SA(b)	4.38%	01/14/2026	2,800	2,380,852	0.2
Bank of Ireland Group PLC(b)	7.50%	05/19/2025	2,854	2,816,214	0.2
Bankinter SA(b)	6.25%	01/17/2026	3,800	3,667,942	0.3
CaixaBank SA(b)	6.75%	06/13/2024	11,600	11,196,371	0.8
Commerzbank AG(b)	6.13%	10/09/2025	4,000	3,633,492	0.2
Raiffeisen Bank International AG(b)	6.00%	06/15/2026	2,400	1,909,378	0.1
Virgin Money UK PLC(b)	8.25%	06/17/2027	GBP 2,753	2,993,672	0.2
				<u>39,921,066</u>	<u>2.8</u>
FINANZEN					
doValue SpA.	5.00%	08/04/2025	EUR 4,390	4,207,393	0.3
LeasePlan Corp. NV(b)	7.38%	05/29/2024	3,015	2,948,284	0.2
Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	2,210	2,157,119	0.2
				<u>9,312,796</u>	<u>0.7</u>
VERSICHERUNGEN					
Intesa Sanpaolo Vita SpA(b)	4.75%	12/17/2024	1,700	1,677,100	0.1
SONSTIGE FINANZWERTE					
Intrum AB	4.88%	08/15/2025	4,910	4,678,707	0.3
Motion Finco SARL	7.00%	05/15/2025	5,825	5,801,140	0.4
				<u>10,479,847</u>	<u>0.7</u>
REITS					
ADLER Group SA	2.25%	01/14/2029	2,600	1,353,916	0.1
ADLER Group SA	3.25%	08/05/2025	6,100	3,527,575	0.3
Aedas Homes Opco SLU	4.00%	08/15/2026	3,250	2,850,963	0.2
Emeria SASU	3.38%	03/31/2028	740	627,931	0.0
Heimstaden Bostad AB(b)	2.63%	02/01/2027	2,118	1,522,548	0.1
Heimstaden Bostad AB(b)	3.00%	10/29/2027	2,100	1,421,773	0.1
Iron Mountain UK PLC	3.88%	11/15/2025	GBP 4,860	5,097,336	0.4
Neinor Homes SA	4.50%	10/15/2026	EUR 3,180	2,677,036	0.2
Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA	5.25%	04/01/2026	3,250	2,916,108	0.2
Vivion Investments SARL	3.00%	08/08/2024	6,600	5,896,374	0.4
Vivion Investments SARL	3.50%	11/01/2025	1,600	1,394,202	0.1
				<u>29,285,762</u>	<u>2.1</u>
				<u>90,676,571</u>	<u>6.4</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
ContourGlobal Power Holdings SA	3.13%	01/01/2028	3,257	2,559,873	0.2
EDP - Energias de Portugal SA	4.50%	04/30/2079	6,700	6,607,104	0.5
				<u>9,166,977</u>	<u>0.7</u>
ERDGAS					
UGI International LLC	2.50%	12/01/2029	4,350	3,394,584	0.2
				<u>12,561,561</u>	<u>0.9</u>
				<u>600,173,740</u>	<u>42.5</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
AIB Group PLC	3.63%	07/04/2026	1,560	1,549,527	0.1
Bank of America Corp.	1.38%	02/07/2025	5,980	5,877,366	0.4
Bank of America Corp.	1.95%	10/27/2026	2,631	2,530,950	0.2
Barclays PLC	3.38%	04/02/2025	5,740	5,750,908	0.4
Barclays PLC(b)	8.88%	09/15/2027	GBP 1,372	1,598,910	0.1
Commerzbank AG	0.00%	12/06/2032	EUR 2,800	2,794,176	0.2
Cooperatieve Rabobank UA(b)	4.38%	06/29/2027	17,600	15,761,244	1.1

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
Erste Group Bank AG(b)	4.25%	10/15/2027	EUR	18,600	14,858,738	1.1%
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	7.13%	08/07/2025	GBP	11,430	13,976,179	1.0
HSBC Holdings PLC(b)	4.75%	07/04/2029	EUR	15,365	12,965,623	0.9
HSBC Holdings PLC(b)	6.00%	09/29/2023		5,281	5,282,578	0.4
HSBC Holdings PLC	6.75%	09/11/2028	GBP	7,050	8,375,717	0.6
ING Groep NV	0.10%	09/03/2025	EUR	4,400	4,141,669	0.3
Ing Groep NV	4.13%	08/24/2033		4,400	4,250,682	0.3
KBC Group NV(b)	4.25%	10/24/2025		13,000	11,302,003	0.8
Lloyds Banking Group PLC	2.71%	12/03/2035	GBP	10,214	9,070,280	0.6
Morgan Stanley	2.10%	05/08/2026	EUR	3,420	3,329,163	0.2
Natwest Group PLC	2.00%	03/04/2025		5,800	5,712,589	0.4
Skandinaviska Enskilda Banken AB	0.75%	08/09/2027		3,784	3,360,772	0.2
Swedbank AB	1.30%	02/17/2027		2,040	1,859,946	0.1
Swedbank AB	2.10%	05/25/2027		1,865	1,802,457	0.1
Swedbank AB	3.63%	08/23/2032		2,200	2,122,823	0.2
UBS Group AG	1.00%	03/21/2025		3,700	3,601,097	0.3
UBS Group AG	2.75%	06/15/2027		2,100	2,042,512	0.2
					<u>143,917,909</u>	<u>10.2</u>
FINANZEN						
JAB Holdings BV	4.75%	06/29/2032		1,800	1,803,705	0.1
VERSICHERUNGEN						
ASR Nederland NV	3.38%	05/02/2049		13,599	12,189,396	0.9
Assicurazioni Generali SpA	5.50%	10/27/2047		12,804	12,984,353	0.9
Assicurazioni Generali SpA	5.80%	07/06/2032		3,000	3,097,885	0.2
Assicurazioni Generali SpA(b)	6.27%	06/16/2026	GBP	3,000	3,382,453	0.3
CNP Assurances(b)	4.75%	06/27/2028	EUR	12,000	11,236,230	0.8
Credit Agricole Assurances SA(b)	4.25%	01/13/2025		1,900	1,888,025	0.1
Credit Agricole Assurances SA	4.75%	09/27/2048		5,200	5,191,639	0.4
Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059		5,023	4,569,984	0.3
Metropolitan Life Global Funding I	1.75%	05/25/2025		2,519	2,480,007	0.2
Storebrand Livsforsikring AS	6.88%	04/04/2043		4,370	4,440,937	0.3
					<u>61,460,909</u>	<u>4.4</u>
REITs						
Digital Stout Holding LLC	3.75%	10/17/2030	GBP	3,250	3,360,857	0.2
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	3.33%	03/24/2025	EUR	2,120	2,047,717	0.2
Summit Properties Ltd.	2.00%	01/31/2025		3,052	2,760,950	0.2
					<u>8,169,524</u>	<u>0.6</u>
					<u>215,352,047</u>	<u>15.3</u>
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
Celanese US Holdings LLC	4.78%	07/19/2026		5,150	5,056,519	0.3
Glencore Finance Europe Ltd.	3.13%	03/26/2026	GBP	2,430	2,578,153	0.2
					<u>7,634,672</u>	<u>0.5</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
Netflix, Inc.	3.63%	06/15/2030	EUR	2,535	2,291,212	0.2
Pinewood Finance Co., Ltd.	3.63%	11/15/2027	GBP	6,560	6,369,397	0.5
Sky Ltd.	6.00%	05/21/2027		5,000	6,219,021	0.4
Time Warner Cable LLC	5.25%	07/15/2042		10,160	9,959,779	0.7
					<u>24,839,409</u>	<u>1.8</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
AT&T, Inc.	5.50%	03/15/2027		3,750	4,473,905	0.3
AT&T, Inc.	7.00%	04/30/2040		2,900	3,982,468	0.3
AT&T, Inc., Series B(b)	2.88%	03/02/2025	EUR	1,900	1,719,494	0.1
Orange SA	8.13%	11/20/2028	GBP	7,247	10,080,478	0.7
PPF Telecom Group BV	3.25%	09/29/2027	EUR	3,600	3,221,821	0.3
					<u>23,478,166</u>	<u>1.7</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG						
CPUK Finance Ltd.	7.24%	02/28/2024	GBP	2,477	2,937,320	0.2
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Anheuser-Busch InBev SA/NV	9.75%	07/30/2024		11,922	15,070,519	1.1
British American Tobacco PLC, Series 5.25(b)	3.00%	09/27/2026	EUR	4,796	3,698,125	0.2
					<u>18,768,644</u>	<u>1.3</u>
ENERGIE						
BP Capital Markets PLC(b)	3.25%	03/22/2026		6,295	5,772,831	0.4
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE						
Travis Perkins PLC	4.50%	09/07/2023	GBP	1,137	1,276,116	0.1
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Heathrow Funding Ltd.	5.23%	02/15/2023		2,680	3,107,889	0.2
					<u>87,815,047</u>	<u>6.2</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
EDP Finance BV	8.63%	01/04/2024	GBP 9,146	€ 11,159,626	0.8%
Electricite de France SA(b)	5.38%	01/29/2025	EUR 8,000	7,519,903	0.5
Enel SpA(b) (e)	5.46%	01/10/2024	7,010	6,962,554	0.5
Naturgy Finance BV(b)	3.38%	04/24/2024	2,600	2,431,592	0.2
Orsted AS(b)	6.25%	06/26/3013	2,330	2,364,950	0.1
				<u>30,438,625</u>	<u>2.1</u>
				<u>333,605,719</u>	<u>23.6</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
DEUTSCHLAND					
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	6.25%	01/04/2030	77,719	104,048,044	7.4
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	6.50%	07/04/2027	37,200	46,060,887	3.2
				<u>150,108,931</u>	<u>10.6</u>
ITALIEN					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4.75%	09/01/2044	22,581	25,177,236	1.8
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	7.25%	11/01/2026	22,462	26,469,772	1.9
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	9.00%	11/01/2023	46,304	50,142,041	3.5
				<u>101,789,049</u>	<u>7.2</u>
SPANIEN					
Spain Government Bond	4.20%	01/31/2037	3,202	3,698,132	0.3
Spain Government Bond	5.15%	10/31/2044	12,233	16,319,209	1.2
Spain Government Bond	5.75%	07/30/2032	19,153	24,481,968	1.7
Spain Government Bond	6.00%	01/31/2029	13,010	16,003,695	1.1
				<u>60,503,004</u>	<u>4.3</u>
				<u>312,400,984</u>	<u>22.1</u>
GEDECKTE ANLEIHEN					
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.....	0.25%	03/17/2025	3,079	2,929,186	0.2
Bank of Montreal	1.00%	04/05/2026	3,615	3,453,847	0.2
Canadian Imperial Bank of Commerce	0.01%	10/07/2026	5,680	5,171,440	0.4
Canadian Imperial Bank of Commerce	0.38%	03/10/2026	3,710	3,469,492	0.3
Commonwealth Bank of Australia	0.75%	02/28/2028	3,800	3,467,722	0.2
Danske Mortgage Bank PLC	0.01%	11/24/2026	500	455,606	0.0
National Australia Bank Ltd.	0.63%	03/16/2027	3,970	3,660,793	0.3
Royal Bank of Canada	0.01%	01/21/2027	3,150	2,842,312	0.2
Royal Bank of Canada	0.63%	03/23/2026	9,000	8,481,885	0.6
Toronto-Dominion Bank (The)	0.86%	03/24/2027	5,323	4,975,128	0.4
				<u>38,907,411</u>	<u>2.8</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
RCS & RDS SA	3.25%	02/05/2028	2,700	2,111,568	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Allwyn International AS	3.88%	02/15/2027	4,755	4,184,400	0.3
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	4.50%	03/01/2025	3,495	3,353,671	0.3
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	6.00%	01/31/2025	6,247	6,172,037	0.4
				<u>9,525,708</u>	<u>0.7</u>
				<u>15,821,676</u>	<u>1.1</u>
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN					
KANADA					
Export Development Canada	0.50%	02/25/2027	4,769	4,442,270	0.3
				<u>1,305,351,800</u>	<u>92.4</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
MAKLER					
Kane Bidco Ltd.	6.50%	02/15/2027	GBP 1,953	2,003,414	0.2
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Summer BidCo BV(c) (d)	9.00%	11/15/2025	EUR 7,136	5,775,095	0.4
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Maison Finco PLC	6.00%	10/31/2027	GBP 6,013	5,111,344	0.4
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Bellis Acquisition Co. PLC	4.50%	02/16/2026	3,909	3,603,822	0.2

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (EUR)	Nettovermögen %
COMMUNICATIONS – TELECOMMUNICATIONS					
Hellas Telecommunications/Luxembourg III(d) (f)	8.50%	10/15/2049	EUR 641	€ 0	0.0%
PLT VII Finance SARL	4.63%	01/05/2026	2,850	2,624,021	0.2
				2,624,021	0.2
				17,114,282	1.2
				19,117,696	1.4
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO, Series 2022-3, Class A	0.92%	10/25/2034	3,700	3,511,215	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 3 DAC, Series 2022-3A, Class D(a)	3.20%	10/25/2034	12,400	10,948,516	0.8
Richmond Park CLO 1 DAC, Series 1X, Class DRR(a)	3.05%	07/14/2031	2,300	2,172,277	0.2
				16,632,008	1.2
STAMMAKTIE					
K201640219 South Africa Ltd. A Shares(f)			18,654,746	19	0.0
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
NIEDERLANDE					
SNS Reaal NV(b) (f)	6.26%	12/31/2049	EUR 770	1	0.0
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
K201640219 South Africa Ltd.(f)	0.00%	06/25/2023	ZAR 84	0	0.0
				35,749,724	2.6
Gesamtanlagen					
(Kosten €1,565,314,892)				€ 1,341,101,524	95.0%
Termineinlagen					
ANZ, London(g)	0.80 %	–		16,428	0.0
Barclays, London(g)	1.68 %	–		973,731	0.1
BNP Paribas, Paris(g)	0.40 %	–		2,376	0.0
BNP Paribas, Paris(g)	0.80 %	–		138	0.0
BNP Paribas, Paris(g)	1.10 %	–		27	0.0
Sumitomo, London(g)	0.87 %	–		465,398	0.0
Sumitomo, Tokyo(g)	(0.13)%	–		41,709,018	3.0
Termineinlagen insgesamt				43,167,116	3.1
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				26,807,861	1.9
Nettovermögen				€ 1,411,076,501	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
Euro Buxl 30 Yr Bond Futures	09/08/2022	518	€ 86,665,340	€ 85,262,800	€ (1,402,540)
Euro-Bund Futures	09/08/2022	784	117,097,880	116,008,480	(1,089,400)
Short					
Euro-BOBL Futures	09/08/2022	703	89,476,850	86,525,240	2,951,610
Euro-Schatz Futures	09/08/2022	303	33,099,720	32,908,830	190,890
Long Gilt Future	12/28/2022	611	77,721,766	76,231,225	1,490,541
					€ 2,141,101
				Wertsteigerung	€ 4,633,041
				Wertminderung	€ (2,491,940)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 571	EUR 83	09/06/2022	€ 807
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3,185	CNH 21,957	09/06/2022	(17,809)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 27,263	HKD 218,183	09/06/2022	395,081
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 27,014	HKD 212,959	09/06/2022	(18,094)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 57	PLN 269	09/06/2022	213
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 0*	PLN 2	09/06/2022	0
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 5,608	SGD 7,901	09/06/2022	16,561

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausbungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 5,505	SGD 7,698	09/06/2022	€ (24,841)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 317,316	USD 323,806	09/06/2022	4,810,789
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 314,653	USD 316,234	09/06/2022	(58,609)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	HKD 5,067	EUR 645	09/06/2022	2,495
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	HKD 216,342	EUR 27,029	09/06/2022	(395,227)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	PLN 137	EUR 29	09/06/2022	(7)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 188	EUR 136	09/06/2022	1,392
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 7,924	EUR 5,625	09/06/2022	(16,550)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 6,780	EUR 6,782	09/06/2022	37,801
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 323,247	EUR 316,760	09/06/2022	(4,810,870)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD 172,895	EUR 118,335	09/12/2022	675,055
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CHF 2,460	EUR 2,529	09/12/2022	25,288
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 232,024	AUD 339,115	09/12/2022	(1,246,111)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 4,966	CHF 4,805	09/12/2022	(74,525)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 1,410	SGD 2,000	09/12/2022	12,972
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 1,249	SGD 1,747	09/12/2022	(5,671)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 296,336	USD 307,135	09/12/2022	9,083,186
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 300,477	USD 302,107	09/12/2022	(57,757)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 188	EUR 136	09/12/2022	1,389
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 1,998	EUR 1,409	09/12/2022	(12,974)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 6,782	EUR 6,782	09/12/2022	37,801
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 306,575	EUR 295,780	09/12/2022	(9,083,263)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CNH 413	EUR 60	09/19/2022	674
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 3,024	CNH 20,891	09/19/2022	(12,835)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 16,386	HKD 131,075	09/19/2022	219,834
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 16,332	HKD 128,830	09/19/2022	(10,804)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 318,881	USD 325,372	09/19/2022	4,519,139
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 323,056	USD 324,958	09/19/2022	(67,888)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	HKD 5,068	EUR 645	09/19/2022	2,480
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	HKD 129,234	EUR 16,153	09/19/2022	(219,975)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 6,783	EUR 6,781	09/19/2022	38,336
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 324,813	EUR 318,325	09/19/2022	(4,519,257)
HSBC Bank USA.....	GBP 108,451	EUR 127,839	09/15/2022	2,549,967
JPMorgan Chase Bank, NA.....	GBP 87,051	EUR 102,695	11/17/2022	2,440,528
				€ 4,218,721
			Wertsteigerung	€ 24,871,788
			Wertminderung	€ (20,653,067)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Casino Guichard - Perrachon	12/20/2022	EUR 4,500	€ (332,559)	€ (220,496)
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Jaguar Land Rover Automotive PLC	06/20/2027	EUR 9,200	(1,601,656)	(780,299)
				€ (1,934,215)	€ (1,000,795)

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

- (a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. August 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) Der Kuponsatz wird regelmäßig auf der Grundlage eines vorgegebenen Zeitplans angepasst. Nominalzins per 31. August 2022.
- (e) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 31. August 2022.
- (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
- CHF – Swiss Franc
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- EUR – Euro

GBP – Great British Pound
HKD – Hong Kong Dollar
PLN – Polish Zloty
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

ABS – Asset-Backed Securities
BOBL – Bundesobligationen
CLO – Collateralized Loan Obligations
INTRCONX – Inter-Continental Exchange

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
STAATSANLEIHEN					
Abu Dhabi Government International Bond	3.13%	10/11/2027	USD 3,175	\$ 3,124,994	0.6%
Abu Dhabi Government International Bond	3.13%	04/16/2030	735	709,183	0.1
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	1,106	915,215	0.2
Angolan Government International Bond	8.75%	04/14/2032	2,144	1,747,360	0.4
Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049	8,465	6,313,303	1.3
Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048	479	364,040	0.1
Argentine Republic Government International Bond	0.50%	07/09/2030	16,855	3,994,574	0.8
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	3,315	770,726	0.2
Argentine Republic Government International Bond	1.50%	07/09/2035	7,680	1,724,267	0.3
Argentine Republic Government International Bond	3.50%	07/09/2041	2,951	773,094	0.2
Argentine Republic Government International Bond	3.88%	01/09/2038	4,508	1,260,183	0.3
Bahamas Government International Bond	8.95%	10/15/2032	1,276	815,284	0.2
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	221	188,513	0.0
Bahrain Government International Bond	6.00%	09/19/2044	1,100	821,081	0.2
Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029	3,508	3,437,401	0.7
Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030	2,801	2,811,154	0.6
Brazilian Government International Bond	3.88%	06/12/2030	815	709,712	0.1
Brazilian Government International Bond	4.75%	01/14/2050	3,740	2,713,370	0.5
Chile Government International Bond	2.45%	01/31/2031	825	695,217	0.1
Chile Government International Bond	2.55%	01/27/2032	4,878	4,054,228	0.8
Chile Government International Bond	2.75%	01/31/2027	2,320	2,147,160	0.4
Chile Government International Bond	3.10%	05/07/2041	473	347,892	0.1
Chile Government International Bond	3.10%	01/22/2061	1,755	1,119,690	0.2
Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	9,284	6,837,666	1.4
Colombia Government International Bond	3.88%	02/15/2061	1,556	876,514	0.2
Colombia Government International Bond	5.00%	06/15/2045	1,875	1,256,016	0.3
Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	200	144,788	0.0
Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	2,985	2,380,164	0.5
Dominican Republic International Bond	5.50%	02/22/2029	6,045	5,500,194	1.1
Dominican Republic International Bond	5.88%	01/30/2060	4,800	3,390,900	0.7
Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027	770	751,376	0.2
Dominican Republic International Bond	6.50%	02/15/2048	3,089	2,474,675	0.5
Dominican Republic International Bond	6.85%	01/27/2045	2,596	2,196,540	0.4
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	179	187,592	0.0
Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	1,753	591,928	0.1
Ecuador Government International Bond	1.50%	07/31/2040	3,722	1,272,063	0.3
Ecuador Government International Bond	2.50%	07/31/2035	15,448	5,916,610	1.2
Ecuador Government International Bond	5.50%	07/31/2030	3,287	1,723,124	0.3
Egypt Government International Bond	5.63%	04/16/2030	EUR 2,466	1,660,398	0.3
Egypt Government International Bond	6.38%	04/11/2031	863	581,072	0.1
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	USD 1,167	815,441	0.2
Egypt Government International Bond	7.30%	09/30/2033	824	554,140	0.1
Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	1,898	1,594,320	0.3
Egypt Government International Bond	7.50%	02/16/2061	1,356	786,480	0.2
Egypt Government International Bond	7.90%	02/21/2048	6,001	3,585,597	0.7
Egypt Government International Bond	8.75%	09/30/2051	587	370,654	0.1
El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	3,134	1,661,020	0.3
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	1,881	707,491	0.1
El Salvador Government International Bond	7.63%	02/01/2041	1,755	586,609	0.1
El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035	506	171,977	0.0
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	1,137	417,705	0.1
El Salvador Government International Bond	9.50%	07/15/2052	2,565	935,904	0.2
Gabon Government International Bond	6.63%	02/06/2031	278	206,207	0.0
Gabon Government International Bond	6.95%	06/16/2025	3,807	3,259,268	0.7
Ghana Government International Bond	7.63%	05/16/2029	2,108	795,770	0.2
Ghana Government International Bond	7.88%	02/11/2035	906	327,179	0.1
Ghana Government International Bond	8.75%	03/11/2061	559	198,200	0.0
Ghana Government International Bond	8.95%	03/26/2051	427	149,530	0.0
Guatemala Government Bond	4.38%	06/05/2027	6,687	6,456,298	1.3
Guatemala Government Bond	4.65%	10/07/2041	728	575,484	0.1
Hungary Government International Bond	2.13%	09/22/2031	8,359	6,087,964	1.2
Hungary Government International Bond	5.25%	06/16/2029	1,649	1,584,967	0.3
Hungary Government International Bond	5.50%	06/16/2034	2,987	2,780,105	0.6
Indonesia Government International Bond	1.85%	03/12/2031	7,307	6,111,283	1.2
Indonesia Government International Bond	3.55%	03/31/2032	924	872,127	0.2
Indonesia Government International Bond	4.30%	03/31/2052	403	357,707	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	579	486,830	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	4,045	3,755,024	0.7
Ivory Coast Government International Bond	6.63%	03/22/2048	EUR 730	497,848	0.1
Jamaica Government International Bond	7.88%	07/28/2045	USD 1,132	1,304,135	0.3
Kenya Government International Bond	8.25%	02/28/2048	1,159	785,223	0.2
Lebanon Government International Bond(a)	6.00%	01/27/2023	1,360	96,305	0.0
Lebanon Government International Bond(a)	6.10%	10/04/2022	6,321	439,705	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Lebanon Government International Bond(a)	6.20%	02/26/2025	USD 4,428	\$ 306,639	0.1%
Lebanon Government International Bond(a)	6.60%	11/27/2026	1,719	119,578	0.0
Lebanon Government International Bond(a)	6.65%	04/22/2024	3,748	265,405	0.1
Lebanon Government International Bond(a)	6.65%	11/03/2028	4,936	340,276	0.1
Malaysia Wakala Sukuk Bhd	3.08%	04/28/2051	573	469,609	0.1
Mexico Government International Bond	2.66%	05/24/2031	850	703,375	0.1
Mexico Government International Bond	3.77%	05/24/2061	9,165	6,119,356	1.2
Morocco Government International Bond	2.38%	12/15/2027	2,334	2,004,031	0.4
Nigeria Government International Bond	7.38%	09/28/2033	3,191	2,129,992	0.4
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	3,619	2,225,685	0.4
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	2,993	1,908,037	0.4
Nigeria Government International Bond	8.25%	09/28/2051	1,460	925,275	0.2
Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025	1,567	1,559,165	0.3
Oman Government International Bond	5.63%	01/17/2028	481	471,981	0.1
Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	462	465,465	0.1
Oman Government International Bond	6.50%	03/08/2047	519	452,828	0.1
Oman Government International Bond	6.75%	01/17/2048	1,357	1,206,034	0.2
Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	2,613	1,607,282	0.3
Pakistan Government International Bond	8.25%	04/15/2024	200	142,022	0.0
Pakistan Government International Bond	8.88%	04/08/2051	2,044	1,073,325	0.2
Panama Bonos del Tesoro, Series DOM	3.36%	06/30/2031	1,156	1,000,663	0.2
Panama Government International Bond	2.25%	09/29/2032	905	701,262	0.1
Panama Government International Bond	3.87%	07/23/2060	2,655	1,822,492	0.4
Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026	2,770	2,720,313	0.5
Paraguay Government International Bond	3.85%	06/28/2033	1,929	1,650,260	0.3
Paraguay Government International Bond	4.70%	03/27/2027	617	610,174	0.1
Paraguay Government International Bond	4.95%	04/28/2031	1,330	1,278,712	0.3
Paraguay Government International Bond	5.00%	04/15/2026	4,001	3,992,998	0.8
Peruvian Government International Bond	1.86%	12/01/2032	920	698,223	0.1
Peruvian Government International Bond	2.78%	12/01/2060	5,599	3,477,679	0.7
Philippine Government International Bond	3.00%	02/01/2028	1,805	1,735,255	0.3
Philippine Government International Bond	3.20%	07/06/2046	3,307	2,530,219	0.5
Philippine Government International Bond	3.23%	03/29/2027	409	399,842	0.1
Philippine Government International Bond	3.56%	09/29/2032	4,770	4,555,875	0.9
Philippine Government International Bond	3.75%	01/14/2029	745	735,769	0.1
Philippine Government International Bond	4.20%	03/29/2047	8,154	7,350,321	1.5
Philippine Government International Bond	5.50%	03/30/2026	918	968,591	0.2
Qatar Government International Bond	3.25%	06/02/2026	1,840	1,815,160	0.4
Qatar Government International Bond	4.40%	04/16/2050	6,700	6,507,375	1.3
Qatar Government International Bond	5.10%	04/23/2048	3,138	3,353,737	0.7
Republic of Azerbaijan International Bond	3.50%	09/01/2032	3,090	2,657,014	0.5
Republic of Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028	833	645,575	0.1
Republic of Poland Government International Bond	3.25%	04/06/2026	2,037	2,001,734	0.4
Republic of South Africa Government International Bond	5.38%	07/24/2044	1,288	919,954	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	925	655,594	0.1
Republic of South Africa Government International Bond	5.88%	04/20/2032	1,220	1,079,700	0.2
Romanian Government International Bond	3.00%	02/14/2031	1,528	1,209,794	0.2
Romanian Government International Bond	3.63%	03/27/2032	3,310	2,663,102	0.5
Romanian Government International Bond	4.00%	02/14/2051	2,100	1,440,863	0.3
Romanian Government International Bond	5.25%	11/25/2027	3,118	3,032,255	0.6
Romanian Government International Bond	6.00%	05/25/2034	962	917,508	0.2
Saudi Government International Bond	2.88%	03/04/2023	700	696,850	0.1
Saudi Government International Bond	3.25%	10/26/2026	2,792	2,746,630	0.5
Saudi Government International Bond	3.45%	02/02/2061	1,435	1,092,394	0.2
Saudi Government International Bond	5.00%	04/17/2049	1,617	1,600,830	0.3
Saudi Government International Bond	5.25%	01/16/2050	2,298	2,366,940	0.5
Senegal Government International Bond	4.75%	03/13/2028	EUR 789	662,076	0.1
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	USD 826	665,085	0.1
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	1,780	1,237,434	0.2
Sharjah Sukuk Ltd.	3.76%	09/17/2024	796	778,737	0.2
Sri Lanka Government International Bond(a)	6.20%	05/11/2027	1,769	568,070	0.1
Sri Lanka Government International Bond(a)	6.85%	11/03/2025	5,158	1,746,628	0.3
Sri Lanka Government International Bond(a)	7.55%	03/28/2030	273	87,155	0.0
Sri Lanka Government International Bond(a)	7.85%	03/14/2029	2,614	837,787	0.2
Turkey Government International Bond	4.88%	04/16/2043	5,500	3,107,500	0.6
Turkey Government International Bond	5.75%	05/11/2047	5,186	3,111,600	0.6
Turkey Government International Bond	6.63%	02/17/2045	1,430	950,950	0.2
Ukraine Government International Bond	6.88%	05/21/2031	792	150,480	0.0
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2034	1,405	249,388	0.1
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2026	5,724	1,159,110	0.2
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2028	7,740	1,567,350	0.3
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2029	1,434	290,385	0.1
Ukraine Government International Bond	8.99%	02/01/2026	1,750	367,500	0.1
Ukraine Government International Bond	9.75%	11/01/2030	1,251	256,455	0.1
Uruguay Government International Bond	4.38%	10/27/2027	3,085	3,159,811	0.6

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Uruguay Government International Bond	4.98%	04/20/2055	USD 743	\$ 744,225	0.2%
Uruguay Government International Bond	5.10%	06/18/2050	1,379	1,399,667	0.3
Uruguay Government International Bond	7.88%	01/15/2033	1,110	1,425,795	0.3
Venezuela Government International Bond(b)	7.75%	04/13/2020	2,834	244,415	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	9.00%	05/07/2023	5,842	496,604	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	9.25%	09/15/2027	4,619	392,615	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	9.25%	05/07/2028	8,171	694,552	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	11.95%	08/05/2031	762	64,745	0.0
Venezuela Government International Bond(b)	12.75%	08/23/2022	2,087	180,038	0.0
Zambia Government International Bond(a)	8.97%	07/30/2027	5,080	3,036,252	0.6
				<u>256,373,184</u>	<u>51.0</u>
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	5.13%	08/11/2061	2,345	1,881,569	0.4
Airport Authority(c)	2.40%	03/08/2028	2,978	2,622,129	0.5
Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	1,970	1,540,663	0.3
Comision Federal de Electricidad	4.68%	02/09/2051	1,193	801,398	0.2
Comision Federal de Electricidad	4.69%	05/15/2029	684	614,232	0.1
Comision Federal de Electricidad	5.00%	09/29/2036	1,817	1,508,110	0.3
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.00%	09/30/2029	4,285	3,776,960	0.8
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.15%	01/14/2030	439	387,225	0.1
Development Bank of Kazakhstan	5.75%	05/12/2025	1,657	1,649,543	0.3
DP World Ltd/United Arab Emirates	5.63%	09/25/2048	2,490	2,440,667	0.5
DP World Salaam(c)	6.00%	10/01/2025	4,706	4,672,176	0.9
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	4.70%	05/07/2050	1,375	1,164,625	0.2
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	5.00%	01/25/2047	240	202,995	0.0
Eskom Holdings SOC Ltd.	6.75%	08/06/2023	1,300	1,260,431	0.3
Eskom Holdings SOC Ltd.	7.13%	02/11/2025	3,285	3,081,330	0.6
Export-Import Bank of China (The)	4.00%	11/28/2047	5,917	5,538,489	1.1
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.80%	05/15/2050	1,375	1,165,141	0.2
KazMunayGas National Co. JSC	4.75%	04/19/2027	3,192	2,941,428	0.6
KazMunayGas National Co. JSC	5.38%	04/24/2030	3,747	3,484,242	0.7
KazMunayGas National Co. JSC	5.75%	04/19/2047	1,546	1,266,947	0.3
KazMunayGas National Co. JSC	6.38%	10/24/2048	690	573,045	0.1
Lamar Funding Ltd.	3.96%	05/07/2025	4,303	4,112,861	0.8
MDGH GMTN RSC Ltd., Series G	3.00%	03/28/2027	2,245	2,170,354	0.4
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.50%	10/25/2027	3,192	3,247,860	0.6
Oil and Gas Holding Co., BSCC (The)	7.63%	11/07/2024	2,935	2,975,907	0.6
Pertamina Persero PT	2.30%	02/09/2031	6,250	5,171,875	1.0
Pertamina Persero PT	5.63%	05/20/2043	455	435,037	0.1
Pertamina Persero PT	6.00%	05/03/2042	1,850	1,850,925	0.4
Pertamina Persero PT	6.45%	05/30/2044	1,854	1,927,349	0.4
Petroleos de Venezuela SA(a)	5.38%	04/12/2027	7,377	247,140	0.0
Petroleos de Venezuela SA(a)	5.50%	04/12/2037	8,347	250,410	0.1
Petroleos de Venezuela SA(b)	9.00%	11/17/2021	9,326	312,424	0.1
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	3,541	2,223,394	0.4
Petroleos Mexicanos	6.88%	08/04/2026	2,713	2,532,450	0.5
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	3,173	1,975,192	0.4
Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050	4,044	2,760,030	0.5
Petroleos Mexicanos	8.75%	06/02/2029	4,990	4,577,701	0.9
Petronas Energy Canada Ltd.	2.11%	03/23/2028	2,165	1,950,197	0.4
Qatar Energy	3.30%	07/12/2051	7,282	5,776,902	1.2
Sinochem Offshore Capital Co., Ltd.	2.38%	09/23/2031	760	606,548	0.1
Southern Gas Corridor CJSC	6.88%	03/24/2026	2,311	2,426,261	0.5
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic	6.95%	03/18/2030	1,661	1,710,622	0.3
Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027	1,416	1,372,458	0.3
				<u>93,187,242</u>	<u>18.5</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
Absa Group Ltd.(c)	6.38%	05/27/2026	638	584,887	0.1
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	1,800	1,517,962	0.3
Adani Electricity Mumbai Ltd.	3.95%	02/12/2030	503	413,183	0.1
Adani Green Energy Ltd.	4.38%	09/08/2024	1,725	1,535,250	0.3
AES Andes SA	6.35%	10/07/2079	1,162	1,075,576	0.2
Alfa Desarrollo SpA	4.55%	09/27/2051	1,865	1,338,108	0.3
Autopistas del Sol SA/Costa Rica	7.38%	12/30/2030	2,008	1,873,100	0.4
Axtel SAB de CV	6.38%	11/14/2024	735	557,589	0.1
Bank Hapoalim BM	3.26%	01/21/2032	734	637,112	0.1
BBVA Bancomer SA/Texas	6.75%	09/30/2022	1,087	1,085,369	0.2
Bidvest Group UK PLC (The)	3.63%	09/23/2026	1,684	1,538,334	0.3
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	1,110	860,250	0.2
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028	1,050	968,205	0.2
BRF SA	4.88%	01/24/2030	1,825	1,540,209	0.3
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	542	485,090	0.1
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	2,148	2,169,480	0.4
Central American Bottling Corp./CBC Bottling Holdco SL/ Beliv Holdco SL	5.25%	04/27/2029	638	587,758	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
China Modern Dairy Holdings Ltd.....	2.13%	07/14/2026	USD 630	\$ 546,885	0.1%
China SCE Group Holdings Ltd.....	6.00%	02/04/2026	780	149,078	0.0
China SCE Group Holdings Ltd.....	7.00%	05/02/2025	200	41,600	0.0
Cia de Minas Buenaventura SAA.....	5.50%	07/23/2026	782	685,619	0.1
CIFI Holdings Group Co., Ltd.....	4.80%	05/17/2028	200	89,725	0.0
Cometa Energia SA de CV.....	6.38%	04/24/2035	175	170,196	0.0
Country Garden Holdings Co., Ltd.....	3.13%	10/22/2025	200	98,000	0.0
CSN Resources SA.....	4.63%	06/10/2031	1,323	1,018,313	0.2
Ecopetrol SA.....	6.88%	04/29/2030	1,310	1,214,213	0.3
Ecopetrol SA.....	7.38%	09/18/2043	399	331,619	0.1
Embraer Netherlands Finance BV.....	5.40%	02/01/2027	1,017	979,686	0.2
Empresa Generadora de Electricidad Haina SA.....	5.63%	11/08/2028	1,399	1,179,969	0.2
Empresas Publicas de Medellin ESP.....	4.25%	07/18/2029	914	748,223	0.2
Freeport Indonesia PT.....	5.32%	04/14/2032	846	782,550	0.2
Geopark Ltd.....	5.50%	01/17/2027	685	593,296	0.1
Globo Comunicacao e Participacoes SA.....	5.50%	01/14/2032	1,270	1,035,288	0.2
GNL Quintero SA.....	4.63%	07/31/2029	165	160,273	0.0
Gran Colombia Gold Corp.....	6.88%	08/09/2026	2,400	1,901,390	0.4
Gran Tierra Energy International Holdings Ltd.....	6.25%	02/15/2025	470	399,588	0.1
Gran Tierra Energy, Inc.....	7.75%	05/23/2027	807	666,735	0.1
Haidilao International Holding Ltd.....	2.15%	01/14/2026	947	729,190	0.2
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.....	3.25%	11/13/2024	465	411,386	0.1
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.....	3.75%	05/29/2024	227	208,173	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.....	4.50%	05/29/2029	1,047	803,442	0.2
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru.....	6.38%	06/01/2028	1,095	1,037,152	0.2
India Clean Energy Holdings.....	4.50%	04/18/2027	1,455	1,105,800	0.2
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.....	8.25%	10/22/2025	945	906,728	0.2
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT.....	3.54%	04/27/2032	0	0	0.0
Intercorp Financial Services, Inc.....	4.13%	10/19/2027	673	593,207	0.1
Ioche-Maxion Austria GmbH/Maxion Wheels de Mexico S de RL de CV.....	5.00%	05/07/2028	1,100	939,950	0.2
Israel Electric Corp. Ltd., Series G.....	3.75%	02/22/2032	204	189,210	0.0
Joy Treasure Assets Holdings, Inc.....	4.50%	03/20/2029	740	657,814	0.1
JSW Hydro Energy Ltd.....	4.13%	05/18/2031	1,486	1,198,205	0.2
JSW Infrastructure Ltd.....	4.95%	01/21/2029	1,201	993,302	0.2
JSW Steel Ltd.....	3.95%	04/05/2027	200	167,000	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(a).....	9.95%	07/23/2025	550	61,119	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(a).....	10.50%	01/15/2025	434	48,011	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(a).....	11.65%	06/01/2026	200	21,975	0.0
Kaisa Group Holdings Ltd.(a).....	11.70%	11/11/2025	376	41,078	0.0
Kallpa Generacion SA.....	4.13%	08/16/2027	925	860,250	0.2
KWG Group Holdings Ltd.....	7.40%	01/13/2027	204	25,500	0.0
Leviathan Bond Ltd.....	6.75%	06/30/2030	1,415	1,349,998	0.3
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA.....	4.38%	06/18/2026	940	815,333	0.2
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.....	5.88%	07/05/2034	1,518	1,495,185	0.3
Logan Group Co., Ltd.(a).....	4.25%	07/12/2025	260	42,900	0.0
Logan Group Co., Ltd.(a).....	4.70%	07/06/2026	272	43,520	0.0
Logan Group Co., Ltd.(a).....	5.25%	02/23/2023	200	35,000	0.0
Logan Group Co., Ltd.(a).....	5.25%	10/19/2025	365	60,225	0.0
Medco Oak Tree Pte Ltd.....	7.38%	05/14/2026	1,275	1,198,882	0.2
Melco Resorts Finance Ltd.....	5.75%	07/21/2028	1,055	709,488	0.1
Minejesa Capital BV.....	5.63%	08/10/2037	1,015	828,684	0.2
MV24 Capital BV.....	6.75%	06/01/2034	555	510,300	0.1
National Central Cooling Co. PJSC.....	2.50%	10/21/2027	974	886,340	0.2
Natura & Co., Luxembourg Holdings SARL.....	6.00%	04/19/2029	848	745,604	0.2
NBM US Holdings, Inc.....	7.00%	05/14/2026	2,240	2,235,520	0.5
OEC Finance Ltd.(d).....	4.38%	10/25/2029	950	25,180	0.0
OEC Finance Ltd.(d).....	5.25%	12/27/2033	1,586	40,978	0.0
OEC Finance Ltd.(d).....	7.13%	12/26/2046	552	14,914	0.0
Peru LNG Srl.....	5.38%	03/22/2030	1,977	1,670,565	0.3
Petrobras Global Finance BV.....	7.38%	01/17/2027	1,305	1,383,300	0.3
Power Finance Corp., Ltd., Series G.....	3.35%	05/16/2031	620	527,558	0.1
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.....	4.90%	05/13/2026	400	50,000	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.....	5.95%	04/30/2025	220	25,616	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.....	6.25%	08/10/2024	350	46,988	0.0
Prosus NV.....	3.26%	01/19/2027	953	824,345	0.2
Prosus NV.....	3.68%	01/21/2030	895	721,307	0.2
Raizen Fuels Finance SA.....	5.30%	01/20/2027	865	861,216	0.2
ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd. other 9 Subsidiaries.....	4.50%	07/14/2028	755	603,056	0.1
Saudi Arabian Oil Co.....	1.63%	11/24/2025	2,450	2,266,250	0.5
Scenery Journey Ltd.(a).....	11.50%	10/24/2022	304	13,680	0.0
SEPLAT Energy PLC.....	7.75%	04/01/2026	1,461	1,285,680	0.3
Shimao Group Holdings Ltd.(a).....	5.20%	01/16/2027	1,390	184,175	0.0

AB FCP I
Emerging Markets Debt Portfolio

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Shimao Group Holdings Ltd.(a)	5.60%	07/15/2026	USD 400	\$ 54,000	0.0%
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	06/15/2028	1,092	797,640	0.2
Studio City Co., Ltd.	7.00%	02/15/2027	254	210,820	0.1
Studio City Finance Ltd.	6.50%	01/15/2028	830	465,838	0.1
Sunac China Holdings Ltd.(a)	5.95%	04/26/2024	250	35,000	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(a)	6.50%	01/10/2025	280	39,200	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(a)	6.50%	01/26/2026	200	28,000	0.0
Sunac China Holdings Ltd.(a)	7.00%	07/09/2025	280	39,200	0.0
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	3.25%	08/15/2030	2,279	1,716,087	0.3
Times China Holdings Ltd.	5.55%	06/04/2024	250	43,750	0.0
Times China Holdings Ltd.	5.75%	01/14/2027	530	74,200	0.0
Times China Holdings Ltd.	6.20%	03/22/2026	200	28,000	0.0
Times China Holdings Ltd.	6.75%	07/08/2025	200	30,000	0.0
TransJamaican Highway Ltd.	5.75%	10/10/2036	1,807	1,528,168	0.3
Transportadora de Gas del Peru SA	4.25%	04/30/2028	935	897,775	0.2
TSMC Arizona Corp.	3.88%	04/22/2027	1,202	1,179,138	0.2
Tullow Oil PLC	10.25%	05/15/2026	1,421	1,310,304	0.3
UEP Penonome II SA	6.50%	10/01/2038	3,546	3,160,329	0.6
Vale Overseas Ltd.	3.75%	07/08/2030	1,370	1,194,297	0.2
Vedanta Resources Finance II PLC	13.88%	01/21/2024	2,066	1,784,507	0.4
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026	795	688,569	0.1
Weibo Corp.	3.38%	07/08/2030	514	406,232	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	1,100	770,000	0.1
Xiaomi Best Time International Ltd.	2.88%	07/14/2031	1,007	740,963	0.2
Yango Justice International Ltd.(a)	7.50%	02/17/2025	925	50,875	0.0
Yango Justice International Ltd.(a)	8.25%	11/25/2023	200	11,000	0.0
Yango Justice International Ltd.(a)	9.25%	04/15/2023	530	29,150	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.(a)	7.70%	02/20/2025	200	14,000	0.0
Zorlu Yenilenebilir Enerji AS	9.00%	06/01/2026	1,402	1,003,131	0.2
				<u>82,390,160</u>	<u>16.4</u>
SCHATZOBIGATIONEN					
U.S. Treasury Bonds	2.00%	11/15/2041	3,890	3,034,200	0.6
U.S. Treasury Notes	0.13%	08/15/2023	4,755	4,604,920	0.9
U.S. Treasury Notes	1.88%	02/15/2032	3,505	3,143,000	0.6
U.S. Treasury Notes	2.50%	03/31/2027	4,165	4,016,622	0.8
				<u>14,798,742</u>	<u>2.9</u>
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE					
Brazil Letras do Tesouro Nacional, Series LTN	0.00%	01/01/2024	BRL 14,145	2,312,847	0.5
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2029	39,970	7,002,122	1.4
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2031	7,092	1,215,745	0.2
				<u>10,530,714</u>	<u>2.1</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
AB SICAV I - Emerging Market Corporate Debt Portfolio - Class S			120,265	2,857,487	0.6
INFLATIONSgebundene Wertpapiere					
Fideicomiso PA Concesion Ruta al Mar	6.75%	02/15/2044	COP 4,270,213	600,182	0.1
				<u>460,737,711</u>	<u>91.6</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
BBFI Liquidating Trust(c) (e)	0.00%	12/30/2099	USD 5,162	3,086,344	0.6
Chile Electricity PEC SpA	0.00%	01/25/2028	3,495	2,413,734	0.5
Digicel Group Holdings Ltd.(c) (d)	7.00%	09/15/2022	223	94,748	0.0
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd.	7.13%	10/10/2022	INR 160,000	2,009,148	0.4
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	USD 3,385	22,007	0.0
Tonon Luxembourg SA(a) (d) (e)	6.50%	10/31/2024	1,523	152	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(b) (e)	10.50%	01/28/2018	1,016	102	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(b) (e)	11.75%	02/09/2022	2,561	256	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(b) (e)	10.88%	01/13/2020	2,474	247	0.0
				<u>7,626,738</u>	<u>1.5</u>
QUASI-STAAANLEIHEN					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC(a)	7.38%	07/19/2022	4,396	1,099,000	0.2
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC(a)	7.63%	11/08/2026	1,322	260,930	0.1
State Agency of Roads of Ukraine	6.25%	06/24/2030	2,984	519,962	0.1
				<u>1,879,892</u>	<u>0.4</u>
STAAANLEIHEN					
Ghana Government International Bond	8.63%	06/16/2049	1,706	594,754	0.1
Ukraine Government International Bond	6.75%	06/20/2028	EUR 1,222	227,189	0.1
				<u>821,943</u>	<u>0.2</u>
				<u>10,328,573</u>	<u>2.1</u>

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Gesamtanlagen				
(Kosten \$635,394,229).....			\$ 471,066,284	93.7%
Termineinlagen				
Barclays, London(g)	0.01 %	–	190	0.0
ANZ, London(f)	0.80 %	–	229	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(f)	1.37 %	–	26	0.0
Barclays, London(f)	1.68 %	–	12,057,306	2.4
BBH, Grand Cayman(f)	1.65 %	–	225	0.0
BBH, Grand Cayman(f)	4.15 %	–	32,843	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(f)	(0.13)%	–	473,012	0.1
Sumitomo, London(f)	0.87 %	–	159	0.0
Termineinlagen insgesamt			<u>12,563,800</u>	<u>2.5</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			<u>18,881,798</u>	<u>3.8</u>
Nettovermögen			<u>\$ 502,511,882</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
U.S. 2 Yr Note (CBT) Futures	12/30/2022	38	\$ 7,931,008	\$ 7,916,469	\$ (14,539)
U.S. 10 Yr Ultra Futures	12/20/2022	12	1,515,719	1,502,250	(13,469)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	12/20/2022	42	4,950,422	4,910,063	(40,359)
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	12/20/2022	13	1,961,781	1,943,500	(18,281)
					<u>\$ (86,648)</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	EUR 530	USD 550	09/29/2022	\$ 15,752
Barclays Bank PLC	INR 162,017	USD 2,033	09/28/2022	23
BNP Paribas SA	COP 2,162,205	USD 474	09/15/2022	(12,941)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 3,618	USD 3,679	09/29/2022	36,254
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 502	EUR 491	09/29/2022	(7,932)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 81,739	USD 83,425	09/06/2022	1,260,118
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 1,472	USD 1,473	09/06/2022	(7,313)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 79,538	EUR 79,909	09/06/2022	787,765
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 83,637	EUR 81,952	09/06/2022	(1,258,579)
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD 74,995	USD 53,157	09/12/2022	1,834,301
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD 1,291	USD 1,010	09/12/2022	26,903
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF 16	USD 17	09/12/2022	659
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 294	USD 360	09/12/2022	18,466
Brown Brothers Harriman & Co.	NZD 4,432	USD 2,841	09/12/2022	129,138
Brown Brothers Harriman & Co.	PLN 8,591	USD 1,894	09/12/2022	69,180
Brown Brothers Harriman & Co.	PLN 520	USD 108	09/12/2022	(1,980)
Brown Brothers Harriman & Co.	SGD 6,802	USD 4,967	09/12/2022	99,413
Brown Brothers Harriman & Co.	SGD 2	USD 1	09/12/2022	0
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 102,304	AUD 146,426	09/12/2022	(2,097,795)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 1,967	CAD 2,540	09/12/2022	(33,093)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 33	CHF 31	09/12/2022	(891)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 698	GBP 581	09/12/2022	(22,781)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 5,495	NZD 8,733	09/12/2022	(151,931)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 1,794	PLN 8,617	09/12/2022	36,585
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 1,919	PLN 8,710	09/12/2022	(68,671)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 4,628	SGD 6,468	09/12/2022	146
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 4,814	SGD 6,589	09/12/2022	(99,089)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 55,117	ZAR 915,207	09/12/2022	(1,731,935)
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR 466,574	USD 28,780	09/12/2022	1,563,859
Brown Brothers Harriman & Co.	CNH 2	USD 0*	09/19/2022	2
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 12	CNH 79	09/19/2022	(181)
Citibank, NA	EUR 310	USD 317	09/29/2022	5,060
Deutsche Bank AG	BRL 23,186	USD 4,286	09/02/2022	(170,865)
Deutsche Bank AG	USD 4,477	BRL 23,186	09/02/2022	(20,137)
Goldman Sachs Bank USA	USD 1,184	BRL 6,121	10/04/2022	(17,410)
Morgan Stanley & Co. LL	CBRL 99,015	USD 19,232	09/02/2022	199,824
Morgan Stanley & Co. LL	CUSD 19,475	BRL 99,015	09/02/2022	(442,720)

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley & Co. LLC.	BRL	74,642	USD	14,678	10/04/2022	\$ 446,151
Morgan Stanley & Co. LLC.	USD	1,087	BRL	5,688	10/04/2022	(2,849)
						<u>\$ 380,506</u>
					Wertsteigerung	\$ 6,529,599
					Wertminderung	\$ (6,149,093)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte					
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	CDX-EM Series 37, 5 Year Index	06/20/2027	USD 3,510	\$ 324,695	\$ (769)
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Federative Republic of Brazil	06/20/2027	USD 10,980	738,096	26,185
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Federative Republic of Brazil	06/20/2027	USD 2,150	144,527	(1,065)
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Republic of Colombia	06/20/2027	USD 4,670	339,993	3,613
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Republic of Panama	06/20/2027	USD 11,504	269,855	157,455
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Republic of South Africa	06/20/2027	USD 1,585	120,959	2,225
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Republic of Turkey	06/20/2027	USD 4,100	986,314	162
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	United Mexican States	06/20/2027	USD 2,020	54,223	2,428
Verkaufskontrakte					
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	People's Republic of China	06/20/2027	USD 4,480	52,588	24
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Republic of Chile	06/20/2027	USD 11,499	(257,396)	(116,336)
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Republic of Colombia	06/20/2027	USD 14,610	(1,063,660)	(30,094)
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Republic of Indonesia	06/20/2027	USD 4,370	(33,555)	(6,061)
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Republic of South Africa	06/20/2027	USD 1,999	(152,553)	30,588
Insgesamt				<u>\$ 1,524,086</u>	<u>\$ 68,355</u>
				Wertsteigerung	\$ 222,680
				Wertminderung	\$ (154,325)

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

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

Währungskürzel:

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

Glossar:

- 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)	Nettowert- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2021-1A, Class M1C(a)	5.13%	03/25/2031	USD 3,000	\$ 2,940,730	0.4%
Series 2021-1A, Class M2(a)	7.03%	03/25/2031	1,000	970,462	0.1
Series 2022-1, Class M2(a)	6.78%	01/26/2032	500	480,760	0.1
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2018-R07, Class 1B1(a)	6.79%	04/25/2031	2,000	1,991,177	0.2
Series 2019-R04, Class 2B1(a)	7.51%	06/25/2039	2,697	2,767,334	0.3
Series 2019-R06, Class 2B1(a)	6.19%	09/25/2039	3,500	3,432,333	0.4
Series 2020-R02, Class 2B1(a)	5.44%	01/25/2040	4,000	3,736,720	0.5
Series 2020-SBT1, Class 1B1(a)	9.19%	02/25/2040	1,000	943,218	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2B1(a)	9.04%	02/25/2040	1,000	903,262	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2M2(a)	6.09%	02/25/2040	2,840	2,875,139	0.3
Series 2021-R01, Class 1B2(a)	8.16%	10/25/2041	500	465,542	0.1
Series 2022-R01, Class 1B2(a)	8.18%	12/25/2041	2,500	2,229,091	0.3
Series 2022-R01, Class 1M2(a)	4.08%	12/25/2041	7,215	6,898,424	0.8
Series 2022-R02, Class 2B1(a)	6.68%	01/25/2042	2,000	1,894,997	0.2
Series 2022-R02, Class 2B2(a)	9.83%	01/25/2042	1,000	947,606	0.1
Series 2022-R05, Class 2B2(a)	9.18%	04/25/2042	2,000	1,977,291	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Series 2018-HQA2, Class B2(a)	13.44%	10/25/2048	7,550	8,427,842	1.0
Series 2019-DNA4, Class B2(a)	8.69%	10/25/2049	3,850	3,742,105	0.5
Series 2019-HQA2, Class B2(a)	13.69%	04/25/2049	1,900	2,073,837	0.3
Series 2019-HQA3, Class B2(a)	9.94%	09/25/2049	5,650	5,622,669	0.7
Series 2020-DNA1, Class B2(a)	7.69%	01/25/2050	7,500	6,907,254	0.8
Series 2020-DNA2, Class B2(a)	7.24%	02/25/2050	8,651	7,648,106	0.9
Series 2020-DNA5, Class B2(a)	13.68%	10/25/2050	3,000	3,595,791	0.4
Series 2020-HQA1, Class B2(a)	7.54%	01/25/2050	6,000	5,377,057	0.7
Series 2020-HQA2, Class B2(a)	10.04%	03/25/2050	6,000	5,899,006	0.7
Series 2020-HQA3, Class M2(a)	6.04%	07/25/2050	1	942	0.0
Series 2021-DNA1, Class B1(a)	4.83%	01/25/2051	4,400	4,080,824	0.5
Series 2021-DNA1, Class B2(a)	6.93%	01/25/2051	2,000	1,674,915	0.2
Series 2021-DNA3, Class B2(a)	8.43%	10/25/2033	1,000	912,265	0.1
Series 2021-DNA5, Class B1(a)	5.23%	01/25/2034	4,000	3,691,395	0.4
Series 2021-DNA5, Class B2(a)	7.68%	01/25/2034	3,000	2,567,777	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency					
Credit Risk Debt Notes					
Series 2015-DNA1, Class B(a)	11.64%	10/25/2027	7,247	7,416,947	0.9
Series 2015-DNA1, Class M3(a)	5.74%	10/25/2027	1,533	1,555,022	0.2
Series 2015-DNA2, Class B(a)	9.99%	12/25/2027	7,297	7,497,529	0.9
Series 2015-DNA3, Class B(a)	11.79%	04/25/2028	6,435	6,836,110	0.8
Series 2015-HQ1, Class B(a)	13.19%	03/25/2025	2,327	2,327,737	0.3
Series 2015-HQ2, Class B(a)	10.39%	05/25/2025	2,839	2,884,725	0.4
Series 2015-HQA1, Class B(a)	11.24%	03/25/2028	3,455	3,487,451	0.4
Series 2015-HQA2, Class B(a)	12.94%	05/25/2028	3,600	3,790,117	0.5
Series 2016-DNA1, Class B(a)	12.26%	07/25/2028	1,916	2,008,558	0.2
Series 2016-DNA2, Class B(a)	12.94%	10/25/2028	6,756	7,168,666	0.9
Series 2016-DNA3, Class B(a)	13.69%	12/25/2028	1,481	1,609,660	0.2
Series 2016-DNA4, Class B(a)	11.04%	03/25/2029	990	988,889	0.1
Series 2016-HQA1, Class B(a)	15.19%	09/25/2028	2,487	2,709,740	0.3
Series 2016-HQA2, Class B(a)	13.94%	11/25/2028	497	547,858	0.1
Series 2018-HQA2, Class B1(a)	6.69%	10/25/2048	2,000	2,063,269	0.3
Series 2018-SPI1, Class B(b)	3.76%	02/25/2048	1,250	986,441	0.1
Series 2018-SPI2, Class B(b)	3.84%	05/25/2048	1,579	1,222,492	0.1
Series 2018-SPI3, Class B(b)	4.16%	08/25/2048	730	594,632	0.1
Series 2018-SPI4, Class B(b)	4.51%	11/25/2048	1,907	1,491,109	0.2
Series 2019-DNA1, Class B2(a)	13.19%	01/25/2049	3,500	3,893,582	0.5
Series 2019-DNA3, Class B1(a)	5.69%	07/25/2049	2,000	1,958,737	0.2
Series 2021-DNA2, Class B1(a)	5.58%	08/25/2033	2,000	1,850,526	0.2
Series 2021-DNA2, Class B2(a)	8.18%	08/25/2033	1,250	1,133,903	0.1
Series 2021-DNA2, Class M2(a)	4.48%	08/25/2033	2,000	1,969,929	0.2
Series 2021-DNA3, Class B1(a)	5.68%	10/25/2033	4,000	3,701,900	0.4
Series 2021-DNA6, Class B1(a)	5.58%	10/25/2041	1,000	946,230	0.1
Series 2021-DNA6, Class B2(a)	9.68%	10/25/2041	1,500	1,417,434	0.2
Series 2021-DNA6, Class M2(a)	3.68%	10/25/2041	4,700	4,441,502	0.5
Series 2021-DNA7, Class B1(a)	5.83%	11/25/2041	2,000	1,896,100	0.2
Series 2021-DNA7, Class B2(a)	9.98%	11/25/2041	1,000	930,628	0.1
Series 2021-DNA7, Class M2(a)	3.98%	11/25/2041	4,650	4,370,993	0.5
Series 2021-HQA3, Class B1(a)	5.53%	09/25/2041	2,000	1,814,937	0.2
Series 2021-HQA3, Class M1(a)	3.03%	09/25/2041	2,819	2,738,124	0.3
Series 2021-HQA4, Class B1(a)	5.93%	12/25/2041	1,967	1,760,264	0.2
Series 2022-DNA1, Class B1(a)	5.58%	01/25/2042	1,000	912,550	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2022-DNA1, Class B2(a)	9.28%	01/25/2042	USD 1,500	\$ 1,332,462	0.2%
Series 2022-DNA1, Class M1B(a)	4.03%	01/25/2042	7,812	7,439,925	0.9
Series 2022-DNA2, Class B1(a)	6.93%	02/25/2042	1,000	950,513	0.1
Series 2022-DNA2, Class B2(a)	10.68%	02/25/2042	500	467,965	0.1
Series 2022-DNA2, Class M1B(a)	4.58%	02/25/2042	5,000	4,855,298	0.6
Series 2022-HQA1, Class M1A(a)	4.28%	03/25/2042	2,651	2,654,147	0.3
Federal National Mortgage Association Connecticut					
Avenue Securities					
Series 2013-C01, Class M2(a)	7.69%	10/25/2023	465	478,559	0.1
Series 2014-C04, Class 1M2(a)	7.34%	11/25/2024	459	479,827	0.1
Series 2015-C04, Class 1M2(a)	8.14%	04/25/2028	4,625	4,856,815	0.6
Series 2015-C04, Class 2M2(a)	7.99%	04/25/2028	2,248	2,320,995	0.3
Series 2016-C01, Class 1B(a)	14.19%	08/25/2028	2,685	2,969,927	0.4
Series 2016-C01, Class 2M2(a)	9.39%	08/25/2028	541	561,195	0.1
Series 2016-C02, Class 1B(a)	14.69%	09/25/2028	6,066	6,813,054	0.8
Series 2016-C02, Class 1M2(a)	8.44%	09/25/2028	645	676,279	0.1
Series 2016-C03, Class 1B(a)	14.19%	10/25/2028	3,478	3,849,196	0.5
Series 2016-C03, Class 2B(a)	15.19%	10/25/2028	3,220	3,662,089	0.4
Series 2016-C04, Class 1B(a)	12.69%	01/25/2029	3,215	3,453,205	0.4
Series 2016-C05, Class 2B(a)	13.19%	01/25/2029	4,921	5,300,416	0.6
Series 2016-C06, Class 1B(a)	11.69%	04/25/2029	5,046	5,265,704	0.6
Series 2016-C07, Class 2B(a)	11.94%	05/25/2029	3,558	3,718,738	0.5
Series 2017-C04, Class 2M2(a)	5.29%	11/25/2029	264	270,491	0.0
Series 2021-R02, Class 2B1(a)	5.48%	11/25/2041	3,000	2,833,711	0.3
Series 2021-R02, Class 2B2(a)	8.38%	11/25/2041	1,000	903,745	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust					
Series 2019-2R, Class A(a)	5.24%	05/27/2023	4,800	4,705,155	0.6
Series 2019-3R, Class A(a)	5.19%	10/27/2022	945	941,396	0.1
Radnor Re Ltd., Series 2021-2, Class M2(a)	7.16%	11/25/2031	4,000	3,715,371	0.5
STACR Trust, Series 2018-DNA3, Class B2(a)	10.19%	09/25/2048	3,015	3,088,446	0.4
Triangle Re Ltd., Series 2021-3, Class M1B(a)	5.08%	02/25/2034	1,500	1,444,326	0.2
				<u>270,609,112</u>	<u>32.6</u>
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Alternative Loan Trust					
Series 2005-50CB, Class 1A1	5.50%	11/25/2035	833	715,238	0.1
Series 2006-11CB, Class 1A2	6.00%	05/25/2036	829	535,833	0.1
Series 2006-28CB, Class A14	6.25%	10/25/2036	399	241,900	0.0
Series 2006-28CB, Class A18	6.00%	10/25/2036	676	397,743	0.0
Angel Oak Mortgage Trust, Series 2021-2, Class A1	0.99%	04/25/2066	3,462	3,097,247	0.4
BCAP LLC Trust, Series 2008-IND2, Class A2	3.05%	04/25/2038	775	622,976	0.1
Brean Asset Backed Securities Trust					
Series 2021-RM2, Class A	1.75%	10/25/2061	5,446	4,833,348	0.6
Series 2021-RM2, Class M2	1.75%	10/25/2061	1,524	1,213,783	0.1
Series 2022-RM3, Class M2	1.75%	02/25/2062	2,475	1,825,624	0.2
Chase Mortgage Finance Trust, Series 2007-S5, Class 1A17	6.00%	07/25/2037	1,563	808,709	0.1
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2006-10, Class 1A8	6.00%	05/25/2036	1,165	619,484	0.1
CitiMortgage Alternative Loan Trust, Series 2007-A6, Class 1A11	6.00%	06/25/2037	106	94,306	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust					
Series 2005-FA8, Class 1A12	5.50%	11/25/2035	88	49,840	0.0
Series 2006-FA2, Class 1A3	6.00%	05/25/2036	174	88,300	0.0
Flagstar Mortgage Trust, Series 2017-1, Class B3	3.62%	03/25/2047	1,615	1,464,437	0.2
JPMorgan Mortgage Trust					
Series 2017-2, Class B3	3.65%	05/25/2047	1,722	1,564,165	0.2
Series 2017-4, Class B3	3.88%	11/25/2048	1,999	1,817,607	0.2
Series 2017-6, Class B3	3.77%	12/25/2048	1,350	1,221,881	0.1
Series 2018-3, Class B2	3.71%	09/25/2048	2,569	2,318,703	0.3
Series 2018-6, Class B2	3.89%	12/25/2048	1,612	1,460,375	0.2
Series 2018-9, Class B2	4.23%	02/25/2049	2,422	2,194,784	0.3
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust,					
Series 2006-7, Class 4A4	6.00%	06/25/2036	434	262,222	0.0
Shellpoint Co-Originator Trust,					
Series 2017-1, Class B3	3.60%	04/25/2047	1,883	1,699,138	0.2
				<u>29,147,643</u>	<u>3.5</u>
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH					
Alternative Loan Trust, Series 2005-19CB, Class A2(a) (c)	11.56%	06/25/2035	66	57,081	0.0
Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust					
Series 2005-AC7, Class A2(a) (c)	13.16%	10/25/2035	239	195,716	0.0
Series 2005-AC9, Class A4(a) (c)	13.05%	12/25/2035	259	160,839	0.0
Chase Mortgage Finance Corp.					
Series 2016-SH1, Class M4(b)	3.75%	04/25/2045	1,129	1,003,497	0.1
Series 2016-SH2, Class M4(b)	3.75%	12/25/2045	495	447,156	0.1
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates,					
Series 2005-9, Class 4A1(a) (c)	12.80%	10/25/2035	59	57,102	0.0
Lehman Mortgage Trust, Series 2007-1, Class 3A2(a) (c)	4.81%	02/25/2037	888	115,560	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
RALI Trust, Series 2006-QO3, Class A1(a)	2.86%	04/25/2046	USD 2,333	\$ 718,048	0.1%
Sequoia Mortgage Trust, Series 2018-7, Class B2(b)	4.25%	09/25/2048	2,347	2,175,537	0.3
Structured Asset Securities Corp Trust, Series 2006-11, Class A3(a)	2.63%	10/28/2035	6,658	4,544,279	0.6
				<u>9,474,815</u>	<u>1.2</u>
VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 3928, Class SE(a) (c)	4.19%	09/15/2041	3,754	511,582	0.1
Series 4416, Class BS(a) (c)	3.71%	12/15/2044	1,564	182,749	0.0
Series 4719, Class JS(a) (c)	3.76%	09/15/2047	2,830	356,290	0.0
Series 4767, Class SB(a) (c)	3.81%	03/15/2048	3,144	398,275	0.0
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2011-131, Class ST(a) (c)	4.10%	12/25/2041	4,122	566,795	0.1
Series 2012-122, Class MS(a) (c)	3.66%	11/25/2042	1,591	219,587	0.0
Series 2013-15, Class SA(a) (c)	3.71%	03/25/2043	3,735	482,544	0.1
Series 2014-40, Class HS(a) (c)	4.26%	07/25/2044	2,262	398,378	0.1
Series 2015-90, Class SL(a) (c)	3.71%	12/25/2045	4,457	560,655	0.1
Series 2016-106, Class ES(a) (c)	3.56%	01/25/2047	1,538	192,484	0.0
Series 2017-20, Class SJ(a) (c)	3.66%	04/25/2047	3,661	476,207	0.1
Series 2018-28, Class SB(a) (c)	3.76%	05/25/2048	3,951	524,213	0.1
Series 2018-30, Class SA(a) (c)	3.76%	05/25/2048	3,112	386,497	0.0
Series 2018-58, Class SA(a) (c)	3.76%	08/25/2048	1,932	283,303	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2014-181, Class TV(a) (c)	3.86%	02/16/2035	3,293	215,969	0.0
Series 2015-3, Class DS(a) (c)	3.23%	11/20/2041	2,643	87,081	0.0
				<u>5,842,609</u>	<u>0.7</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs,					
Series 5040, Class AI(d)	3.50%	11/25/2050	2,730	460,650	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2015-30, Class EI(d)	5.00%	05/25/2045	518	88,660	0.0
Series 2016-64, Class BI(d)	5.00%	09/25/2046	4,544	699,009	0.1
Government National Mortgage Association,					
Series 2021-117, Class MI(d)	3.50%	05/20/2042	15,164	2,098,591	0.2
				<u>3,346,910</u>	<u>0.4</u>
				<u>318,421,089</u>	<u>38.4</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E	4.80%	02/10/2036	2,000	1,772,397	0.2
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2013-WBRK, Class D	3.65%	03/10/2037	3,000	2,611,945	0.3
Banc of America Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-UBS7, Class AS	3.99%	09/15/2048	1,140	1,092,747	0.1
Series 2015-UBS7, Class XA(d)	0.90%	09/15/2048	64,794	1,216,209	0.1
BANK					
Series 2017-BNK5, Class AS	3.62%	06/15/2060	2,500	2,321,530	0.3
Series 2017-BNK6, Class AS	3.74%	07/15/2060	2,500	2,333,980	0.3
Series 2018-BN13, Class AS	4.47%	08/15/2061	5,000	4,794,139	0.6
BBCMS Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class AS	3.90%	02/15/2050	2,500	2,368,702	0.3
Benchmark Mortgage Trust, Series 2018-B2, Class AS	4.08%	02/15/2051	2,500	2,363,317	0.3
Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Series 2018-B1, Class AM	3.88%	01/15/2051	6,809	6,433,397	0.8
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(d)					
	1.17%	11/15/2050	13,743	468,969	0.1
CFCRE Commercial Mortgage Trust					
Series 2016-C4, Class AM	3.69%	05/10/2058	190	180,530	0.0
Series 2016-C7, Class A3	3.84%	12/10/2054	2,500	2,416,044	0.3
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-GC8, Class B	4.29%	09/10/2045	971	956,158	0.1
Series 2013-GC11, Class D	4.33%	04/10/2046	1,056	1,028,295	0.1
Series 2013-GC17, Class D	5.25%	11/10/2046	2,430	2,227,774	0.3
Series 2015-GC29, Class XA(d)	1.16%	04/10/2048	6,382	135,187	0.0
Series 2016-P6, Class AS	4.03%	12/10/2049	3,310	3,148,966	0.4
Series 2017-P8, Class XA(d)	1.02%	09/15/2050	43,253	1,481,662	0.2
Series 2018-C6, Class XA(d)	0.94%	11/10/2051	7,868	294,290	0.0
Commercial Mortgage Trust					
Series 2010-C1, Class D	5.99%	07/10/2046	2,365	2,315,153	0.3
Series 2010-C1, Class F	4.00%	07/10/2046	3,780	3,231,871	0.4
Series 2012-CR1, Class B	4.61%	05/15/2045	935	932,386	0.1
Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	1,500	828,900	0.1
Series 2012-CR3, Class E	4.93%	10/15/2045	2,173	1,086,437	0.1
Series 2012-CR3, Class XA(d)	1.89%	10/15/2045	937	9	0.0
Series 2012-CR5, Class XA(d)	1.54%	12/10/2045	9,788	404	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2013-LC6, Class D	4.43%	01/10/2046	USD 640	\$ 622,389	0.1%
Series 2013-LC6, Class XA(d)	1.38%	01/10/2046	9,607	2,761	0.0
Series 2014-CR16, Class D	5.08%	04/10/2047	1,841	1,686,872	0.2
Series 2014-CR19, Class XA(d)	1.09%	08/10/2047	69,170	956,730	0.1
Series 2014-CR20, Class XA(d)	1.13%	11/10/2047	7,361	113,062	0.0
Series 2014-LC17, Class B	4.49%	10/10/2047	2,000	1,940,732	0.2
Series 2014-UBS2, Class D	5.15%	03/10/2047	1,250	1,171,183	0.1
Series 2014-UBS6, Class AM	4.05%	12/10/2047	190	184,390	0.0
Series 2015-CR22, Class XA(d)	0.96%	03/10/2048	13,715	234,269	0.0
Series 2015-LC19, Class XA(d)	1.24%	02/10/2048	46,207	910,823	0.1
Series 2016-DC2, Class XA(d)	1.10%	02/10/2049	46,508	1,165,239	0.1
CSAIL Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C8, Class XA(d)	1.25%	06/15/2050	53,197	2,049,992	0.3
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class C	5.30%	08/10/2044	4,850	4,025,500	0.5
Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044	493	209,836	0.0
Series 2013-GC12, Class C	4.18%	06/10/2046	5,540	5,443,795	0.7
Series 2013-GC13, Class C	4.21%	07/10/2046	4,537	4,162,260	0.5
Series 2013-GC13, Class D	4.21%	07/10/2046	2,190	953,745	0.1
Series 2014-GC18, Class D	5.23%	01/10/2047	621	256,358	0.0
Series 2014-GC22, Class A5	3.86%	06/10/2047	2,500	2,469,577	0.3
Series 2014-GC22, Class XA(d)	1.09%	06/10/2047	6,465	68,610	0.0
Series 2016-GS3, Class A4	2.85%	10/10/2049	2,500	2,342,451	0.3
Series 2017-GS5, Class XA(d)	0.99%	03/10/2050	52,377	1,634,810	0.2
Series 2017-GS6, Class AS	3.64%	05/10/2050	2,000	1,873,963	0.2
Series 2017-GS7, Class XA(d)	1.24%	08/10/2050	25,884	1,005,976	0.1
Series 2017-GS8, Class XA(d)	1.10%	11/10/2050	36,971	1,314,979	0.2
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2013-C14, Class D	4.70%	08/15/2046	3,425	2,015,375	0.2
Series 2013-C17, Class D	5.05%	01/15/2047	2,535	2,383,462	0.3
Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047	2,000	1,928,333	0.2
Series 2014-C22, Class XA(d)	0.96%	09/15/2047	93,388	1,101,071	0.1
Series 2014-C24, Class C	4.53%	11/15/2047	6,000	5,234,474	0.6
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2011-C4, Class C	5.60%	07/15/2046	30	29,901	0.0
Series 2012-C6, Class E	5.11%	05/15/2045	2,250	1,744,019	0.2
Series 2012-C6, Class G	2.97%	05/15/2045	2,500	1,123,550	0.1
Series 2013-C10, Class B	3.67%	12/15/2047	2,213	2,179,105	0.3
Series 2013-C10, Class D	4.22%	12/15/2047	1,550	1,497,467	0.2
Series 2014-C20, Class XA(d)	0.96%	07/15/2047	9,572	77,865	0.0
Series 2016-JP2, Class XA(d)	1.93%	08/15/2049	39,642	2,105,929	0.3
Series 2016-JP3, Class B	3.40%	08/15/2049	2,000	1,809,108	0.2
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(d)	1.69%	07/12/2050	24,961	1,365,475	0.2
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust					
Series 2012-C6, Class E	4.76%	11/15/2045	425	414,450	0.1
Series 2012-C6, Class XA(d)	1.57%	11/15/2045	1,055	11	0.0
Series 2014-C18, Class C	4.65%	10/15/2047	1,333	1,261,064	0.2
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	1,225	1,069,486	0.1
Series 2014-C19, Class XA(d)	1.10%	12/15/2047	26,588	427,246	0.1
Series 2015-C20, Class XA(d)	1.40%	02/15/2048	55,131	1,137,293	0.1
Series 2015-C22, Class XA(d)	1.15%	04/15/2048	45,707	832,999	0.1
Series 2015-C25, Class XA(d)	1.20%	10/15/2048	29,412	670,489	0.1
Series 2017-C34, Class XA(d)	0.91%	11/15/2052	30,635	895,949	0.1
Morgan Stanley Capital I Trust					
Series 2011-C3, Class C	5.25%	07/15/2049	460	455,540	0.1
Series 2016-UBS9, Class XA(d)	1.27%	03/15/2049	55,990	1,658,819	0.2
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C1, Class D	6.66%	05/10/2045	360	327,965	0.0
Series 2017-C3, Class XA(d)	1.17%	08/15/2050	32,440	1,184,378	0.1
Series 2017-C4, Class XA(d)	1.16%	10/15/2050	17,987	740,246	0.1
Series 2017-C5, Class XA(d)	1.19%	11/15/2050	34,294	1,216,802	0.2
Series 2018-C10, Class XA(d)	1.04%	05/15/2051	73,355	2,940,837	0.4
Series 2018-C14, Class XA(d)	1.15%	12/15/2051	50,200	2,330,187	0.3
Series 2018-C15, Class XA(d)	1.15%	12/15/2051	24,351	1,150,709	0.1
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C4, Class C	4.53%	12/10/2045	7,000	6,911,459	0.8
Series 2012-C4, Class XA(d)	1.65%	12/10/2045	3,933	39	0.0
Series 2013-C6, Class D	4.44%	04/10/2046	3,618	3,090,689	0.4
Series 2013-C6, Class XA(d)	1.22%	04/10/2046	3,055	4,133	0.0
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-C27, Class XA(d)	0.97%	02/15/2048	125,109	2,063,523	0.3
Series 2015-C29, Class C	4.36%	06/15/2048	3,852	3,613,606	0.4
Series 2015-C31, Class A3	3.43%	11/15/2048	1,147	1,103,706	0.1
Series 2015-NXS3, Class A4	3.62%	09/15/2057	1,425	1,386,017	0.2
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	1,313	1,264,151	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 2016-C32, Class XA(d)	1.37%	01/15/2059	USD 55,128	\$ 1,825,294	0.2%
Series 2016-C33, Class XA(d)	1.75%	03/15/2059	34,837	1,544,068	0.2
Series 2016-C35, Class A3	2.67%	07/15/2048	2,419	2,268,684	0.3
Series 2016-C35, Class B	3.44%	07/15/2048	2,500	2,280,068	0.3
Series 2016-C36, Class XA(d)	1.32%	11/15/2059	45,429	1,682,729	0.2
Series 2016-LC25, Class AS(b)	4.01%	12/15/2059	2,216	2,112,981	0.3
Series 2017-C38, Class XA(d)	1.12%	07/15/2050	28,603	1,046,051	0.1
Series 2017-C39, Class A5	3.42%	09/15/2050	2,500	2,379,176	0.3
Series 2018-C46, Class AS	4.38%	08/15/2051	4,500	4,297,973	0.5
Series 2018-C47, Class A4	4.44%	09/15/2061	5,000	4,960,288	0.6
Series 2018-C48, Class A5	4.30%	01/15/2052	2,000	1,969,178	0.2
Series 2018-C48, Class XA(d)	1.12%	01/15/2052	44,155	2,006,087	0.2
WF-RBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2011-C4, Class E	4.99%	06/15/2044	713	557,557	0.1
Series 2011-C5, Class E	5.70%	11/15/2044	968	965,122	0.1
Series 2012-C9, Class D	4.99%	11/15/2045	615	604,663	0.1
Series 2012-C9, Class XA(d)	1.84%	11/15/2045	1,212	12	0.0
Series 2012-C10, Class B	3.74%	12/15/2045	2,500	2,481,700	0.3
Series 2012-C10, Class XA(d)	1.59%	12/15/2045	13,536	135	0.0
Series 2013-C11, Class AS	3.31%	03/15/2045	2,000	1,986,456	0.2
Series 2013-C11, Class XA(d)	1.24%	03/15/2045	15,449	14,505	0.0
Series 2014-C22, Class XA(d)	0.94%	09/15/2057	34,003	403,983	0.1
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	3,164	3,061,779	0.4
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	1,290	1,128,256	0.1
Series 2014-C25, Class XA(d)	0.94%	11/15/2047	22,198	316,419	0.0
				187,481,791	22.6
NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS					
Ashford Hospitality Trust, Series 2018-KEYS, Class A(a)	3.39%	06/15/2035	3,000	2,920,233	0.3
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2017-SCH, Class AF(a)	3.39%	11/15/2033	3,000	2,833,894	0.3
Braemar Hotels & Resorts Trust, Series 2018-PRME,					
Class A(a)	3.21%	06/15/2035	5,000	4,799,954	0.6
BX Trust, Series 2018-EXCL, Class A(a)	3.48%	09/15/2037	815	810,969	0.1
DBWF Mortgage Trust, Series 2018-GLKS, Class E(a)	5.38%	12/19/2030	2,420	2,286,897	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp.,					
Series 2021-MN1, Class M2(a)	5.93%	01/25/2051	1,700	1,572,985	0.2
FS Rialto 2022-FL4 Issuer LLC, Series 2022-FL4, Class A(a)	3.93%	01/19/2039	5,000	4,861,736	0.6
HGI CRE CLO 2021-FL3 Ltd., Series 2022-FL3, Class A(a)	3.68%	04/20/2037	5,000	4,891,623	0.6
Morgan Stanley Capital I Trust					
Series 2019-BPR, Class D(a)	6.64%	05/15/2036	2,750	2,551,826	0.3
Series 2019-BPR, Class E(a)	7.39%	05/15/2036	2,250	1,760,945	0.2
Rial 2022-fl8 A, Series 2022-FL8, Class A(a)	4.55%	01/19/2037	3,000	2,958,424	0.4
				32,249,486	3.9
				219,731,277	26.5
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABLE VERZINSLICH					
522 Funding CLO Ltd., Series 2021-7A, Class A(a)	3.85%	04/23/2034	7,000	6,796,083	0.8
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class D(a)	6.41%	01/20/2034	4,000	3,767,412	0.5
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class D(a)	5.41%	04/15/2034	3,500	3,130,928	0.4
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class E(a)	8.51%	04/15/2034	2,250	2,000,259	0.2
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class D(a)	5.66%	04/15/2034	3,000	2,723,601	0.3
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class E(a)	8.87%	04/15/2034	1,000	896,421	0.1
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class E(a)	8.86%	07/20/2034	3,250	2,881,115	0.4
AGL CLO 13 Ltd., Series 2021-13A, Class E(a)	9.21%	10/20/2034	4,000	3,581,356	0.4
AIG CLO Ltd., Series 2021-3A, Class D(a)	5.88%	01/25/2035	3,000	2,699,160	0.3
AIG CLO Ltd., Series 2021-3A, Class E(a)	9.24%	01/25/2035	3,400	3,065,814	0.4
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class D(a)	5.36%	04/20/2034	3,500	3,187,842	0.4
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class E(a)	8.46%	04/20/2034	3,250	2,943,597	0.4
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class D(a)	5.81%	10/20/2034	5,000	4,465,870	0.5
Ballyrock CLO Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	8.51%	04/20/2031	1,000	859,844	0.1
Ballyrock CLO Ltd., Series 2020-14A, Class C(a)	6.31%	01/20/2034	2,000	1,867,364	0.2
Ballyrock CLO Ltd., Series 2020-14A, Class D(a)	9.71%	01/20/2034	2,000	1,804,820	0.2
Ballyrock CLO Ltd., Series 2021-16A, Class D(a)	8.96%	07/20/2034	3,500	3,103,895	0.4
Ballyrock CLO Ltd., Series 2021-17A, Class D(a)	8.69%	10/20/2034	2,000	1,760,624	0.2
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(a)	4.52%	04/26/2031	5,000	4,751,100	0.6
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class B(a)	8.83%	07/23/2032	4,125	3,892,536	0.5
BlueMountain Fuji US CLO II Ltd., Series 2017-2A, Class D(a)	8.86%	10/20/2030	1,000	868,056	0.1
Carlyle US CLO Ltd., Series 2017-3A, Class D(a)	8.82%	07/20/2029	1,500	1,271,661	0.2
Cedar Funding IX CLO Ltd., Series 2018-9A, Class E(a)	8.06%	04/20/2031	875	767,968	0.1
Dryden 57 CLO Ltd., Series 2018-57A, Class E(a)	8.11%	05/15/2031	1,750	1,551,191	0.2
Dryden CLO Ltd., Series 2018-64A, Class B(a)	4.14%	04/18/2031	3,800	3,647,939	0.4
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-1RA, Class D(a)	5.56%	07/15/2030	1,500	1,375,452	0.2
Elmwood CLO 15 Ltd., Series 2022-2A, Class D(a)	4.31%	04/22/2035	4,000	3,658,856	0.4
Galaxy XXIII CLO Ltd., Series 2017-23A, Class B1R(a)	4.13%	04/24/2029	1,350	1,299,740	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Goldentree Loan Management US CLO 7 Ltd., Series 2020-7A, Class DR(a)	5.86%	04/20/2034	USD 1,000	\$ 936,999	0.1%
Goldentree Loan Opportunities XI Ltd., Series 2015-11A, Class BR2(a)	4.09%	01/18/2031	8,000	7,721,056	0.9
Greywolf CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A2(a)	4.40%	04/26/2031	5,000	4,814,380	0.6
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd., Series 2018-1A, Class C(a)	5.91%	07/21/2031	2,000	1,740,688	0.2
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class B(a)	4.06%	04/15/2034	3,000	2,849,502	0.3
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	8.97%	04/15/2034	3,000	2,688,467	0.3
Jamestown CLO XI Ltd., Series 2018-11A, Class D(a)	8.50%	07/14/2031	1,500	1,292,901	0.2
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(a)	5.46%	10/20/2030	2,000	1,857,178	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2019-33A, Class DR(a)	5.64%	10/16/2033	1,875	1,743,051	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2019-33A, Class ER(a)	8.99%	10/16/2033	2,000	1,812,594	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2020-39A, Class D(a)	6.31%	01/20/2032	1,250	1,202,305	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2020-39A, Class E(a)	9.91%	01/20/2032	2,500	2,311,185	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-42A, Class E(a)	8.69%	07/16/2035	3,625	3,275,528	0.4
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-43A, Class D(a)	5.84%	07/17/2035	3,000	2,807,316	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-44A, Class E(a)	8.74%	10/16/2034	1,500	1,351,604	0.2
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class D(a)	6.06%	10/20/2034	5,000	4,486,225	0.5
OCP CLO Ltd., Series 2018-15A, Class D(a)	8.56%	07/20/2031	1,000	880,157	0.1
Octagon Investment Partners 35 Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	7.91%	01/20/2031	3,000	2,638,431	0.3
OZLM XXII Ltd., Series 2018-22A, Class D(a)	8.04%	01/17/2031	1,750	1,374,625	0.2
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	8.71%	10/20/2034	2,830	2,565,624	0.3
Pikes Peak CLO 1, Series 2018-1A, Class E(a)	8.83%	07/24/2031	1,500	1,301,787	0.2
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class D(a)	6.40%	02/25/2034	5,000	4,618,520	0.6
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class A(a)	3.88%	07/20/2034	10,000	9,728,880	1.2
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class D(a)	5.81%	07/20/2034	5,000	4,515,495	0.5
Pikes Peak CLO 10, Series 2022-10A, Class D(a)	4.73%	04/22/2034	4,000	3,686,048	0.4
PPM CLO 5 Ltd., Series 2021-5A, Class E(a)	9.24%	10/18/2034	1,400	1,183,735	0.1
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(a)	8.46%	07/15/2031	3,000	2,357,949	0.3
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2017-3A, Class B(a)	4.18%	10/20/2030	3,000	2,884,161	0.4
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	5.98%	05/20/2031	3,450	3,149,791	0.4
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2018-2A, Class B(a)	4.51%	10/20/2031	7,000	6,750,310	0.8
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	9.07%	07/20/2034	3,000	2,686,860	0.3
TCW CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(a)	8.83%	04/25/2031	2,250	1,984,754	0.2
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class AR(a)	3.91%	07/20/2031	2,000	1,959,062	0.2
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class B1R(a)	4.46%	07/20/2031	5,000	4,762,205	0.6
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class CR(a)	5.06%	07/20/2031	2,000	1,840,372	0.2
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class DR(a)	6.21%	07/20/2031	4,000	3,535,480	0.4
TRESTLES CLO Ltd., Series 2018-2A, Class A2(a)	4.45%	07/25/2031	3,000	2,887,920	0.4
Venture XXVII CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(a)	6.71%	07/20/2030	1,500	1,360,302	0.2
Whehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class D(a)	4.09%	04/21/2035	3,000	2,737,515	0.3
				<u>188,911,466</u>	<u>22.8</u>
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSAUHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold Pool, Series 2018	4.00%	10/01/2048	4,753	4,711,601	0.6
Federal National Mortgage Association, Series 2000	7.50%	10/01/2030	3	2,710	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.50%	06/01/2031	25	27,072	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2003	5.00%	11/01/2033	139	143,842	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2004	8.00%	09/01/2033	315	343,561	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2008	5.00%	07/01/2037	146	150,292	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2008	5.50%	05/01/2038	184	195,661	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2009	5.00%	05/01/2039	73	75,652	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	02/01/2040	459	476,775	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	04/01/2040	620	644,209	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	12/01/2040	609	631,424	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2011	5.00%	04/01/2041	301	312,520	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2014	5.00%	08/01/2044	734	765,943	0.1
Government National Mortgage Association, Series 2009	5.00%	10/15/2039	142	147,450	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2012	5.50%	06/15/2038	46	48,206	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2014	5.00%	08/20/2041	483	496,075	0.1
				<u>9,172,993</u>	<u>1.1</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 15-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2011	5.00%	07/01/2025	25	25,594	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2011	6.50%	03/01/2026	3	2,720	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold Pool, Series 2012	5.00%	06/01/2026	1	890	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold Pool, Series 2014	3.50%	02/01/2029	417	412,217	0.1
				<u>441,421</u>	<u>0.1</u>
				<u>9,614,414</u>	<u>1.2</u>

	Zinssatz	Datum	Kontrakte/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust, Series 2018-P2, Class C	5.21%	10/15/2025	USD 101	\$ 100,812	0.0%
TGIF Funding LLC, Series 2017-1A, Class A2	6.20%	04/30/2047	5,343	5,133,430	0.6
				<u>5,234,242</u>	<u>0.6</u>
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Octane Receivables Trust 2022-1, Series 2022-1A, Class D	5.54%	02/20/2029	3,708	3,594,109	0.5
BAUSPARDARLEHEN – FESTVERZINSLICH					
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2005-WF1, Class A5	5.01%	11/25/2034	0*	11	0.0
				<u>8,828,362</u>	<u>1.1</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
FINANZEN					
Curo Group Holdings Corp.	7.50%	08/01/2028	5,323	3,229,262	0.4
Enova International, Inc.	8.50%	09/15/2025	1,002	934,434	0.1
				<u>4,163,696</u>	<u>0.5</u>
GEKAUFTE OPTIONEN – VERKAUFSOPTIONEN					
OPTIONEN AUF AKTIENINDIZES					
S&P 500 Index					
Expiration: Oct 2022, Exercise Price: USD 3,700.00			170	946,900	0.1
				<u>750,617,204</u>	<u>90.6</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-7, Class PT	9.35%	06/15/2043	USD 30	28,032	0.0
Series 2018-20, Class PT	11.60%	11/16/2043	98	93,772	0.0
Series 2019-24, Class PT	11.05%	08/15/2044	411	396,233	0.0
Series 2019-44, Class PT	10.95%	11/15/2044	441	427,991	0.1
Consumer Loan Underlying Bond Club Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-3, Class PT	8.22%	03/16/2043	24	22,138	0.0
Series 2018-4, Class PT	10.72%	05/15/2043	22	21,176	0.0
Series 2018-12, Class PT	8.48%	06/15/2043	58	55,533	0.0
Series 2019-48, Class PT	10.32%	12/15/2044	413	398,784	0.0
Dragonfly Energy Corp., Series CLIP(e)	5.50%	11/15/2024	2,900	2,914,500	0.4
SMB Private Education Loan Trust					
Series 2021-A, Class R(e)	0.00%	01/15/2053	2	4,355,780	0.5
Series 2021-C, Class R(e)	0.00%	01/15/2053	14	7,155,000	0.9
Series 2022-A, Class R	0.00%	11/16/2054	3	2,999,584	0.4
SoFi Consumer Loan Program LLC, Series 2016-1, Class R(e)	0.00%	08/25/2025	61	58,459	0.0
				<u>18,926,982</u>	<u>2.3</u>
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Octane Receivables Trust					
Series 2020-1A, Class R1(e)	0.00%	03/20/2028	9	1,400,106	0.2
Series 2021-1A, Class R1(e)	0.00%	11/20/2028	5	1,286,072	0.1
Santander Consumer Auto Receivables Trust					
Series 2021-BA, Class R(e)	0.00%	03/15/2029	5	930,011	0.1
Series 2021-CA, Class R(e)	0.00%	06/15/2028	6	815,771	0.1
				<u>4,431,960</u>	<u>0.5</u>
				<u>23,358,942</u>	<u>2.8</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd., Series 2020-4A, Class B1(a)	7.44%	06/25/2030	500	488,906	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019-FTR2, Class B2(a)	9.84%	11/25/2048	1,000	953,129	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2019-FTR3, Class B2(a)	7.06%	09/25/2047	6,980	5,940,112	0.7
Series 2019-HQA1, Class B2(a)	14.69%	02/25/2049	750	851,564	0.1
JPMorgan Madison Avenue Securities Trust					
Series 2014-CH1, Class M2(a)	6.69%	11/25/2024	582	557,159	0.1
Series 2015-CH1, Class M2(a)	7.94%	10/25/2025	1,351	1,316,631	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2020-1R, Class A(a)	4.84%	02/27/2023	1,342	1,325,867	0.1
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust, Series 2015-WF1, Class 1M2(a)	7.69%	11/25/2025	645	590,743	0.1
				<u>12,024,111</u>	<u>1.4</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(e)	0.00%	10/03/2047	USD 14	\$ 256,552	0.0%
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(e)	4.00%	04/15/2050	226	3,338,448	0.4
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(e)	4.00%	11/15/2047	210	1,208,143	0.1
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(e)	3.40%	10/15/2057	217	5,291,344	0.7
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class XCP(d)	0.00%	04/15/2023	163,600	1,636	0.0
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust, Series 2013-C5, Class XA(d)	1.00%	03/10/2046	27,068	13,036	0.0
				<u>10,109,159</u>	<u>1.2</u>
STAMMAKTIEN					
Mt. Logan Re Ltd. (Preference Shares) (Series 1)(e)			4,000	3,706,546	0.4
Mt. Logan Re Ltd. (Special Investment)(e)			632	564,108	0.1
				<u>4,270,654</u>	<u>0.5</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Virgolino de Oliveira Finance SA(e) (f)	10.88%	01/13/2020	USD 1,665	167	0.0
				<u>49,763,033</u>	<u>5.9</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$972,838,634)				\$ 800,380,237	96.5%
Termineinlagen					
BBH, Grand Cayman(g)	(0.78)%	–		1	0.0
ANZ, London(g)	0.80 %	–		216	0.0
BBH, Grand Cayman(g)	(0.13)%	–		1	0.0
BBH, Grand Cayman(g)	4.15 %	–		12,224	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(g)	0.40 %	–		1	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Singapore(g)	1.10 %	–		13	0.0
Sumitomo, Tokyo(g)	1.68 %	–		34,695,766	4.1
				<u>34,708,221</u>	<u>4.1</u>
Termineinlagen insgesamt					
				<u>(5,375,162)</u>	<u>(0.6)</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					
Nettovermögen					
				<u>\$ 829,713,296</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 189	USD 28	09/06/2022	\$ 500
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3	USD 3	09/06/2022	37
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2	USD 2	09/06/2022	(7)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,431	CNH 23,188	09/06/2022	(67,343)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,682	EUR 1,674	09/06/2022	373
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 637	EUR 624	09/06/2022	(9,555)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 101	USD 71	09/12/2022	1,392
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 1	USD 1	09/12/2022	15
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2	USD 2	09/12/2022	(7)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 3	USD 2	09/12/2022	-
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 29,721	AUD 41,926	09/12/2022	(1,028,673)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,683	EUR 1,674	09/12/2022	358
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 607	EUR 586	09/12/2022	(17,868)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 142	GBP 116	09/12/2022	(7,307)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 781	SGD 1,069	09/12/2022	(16,157)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 6,683	ZAR 108,374	09/12/2022	(361,847)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 506	USD 30	09/12/2022	305
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 64	USD 9	09/19/2022	150
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 1	USD 1	09/19/2022	15
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 1	USD 1	09/19/2022	(2)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,410	CNH 23,138	09/19/2022	(53,312)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,679	EUR 1,670	09/19/2022	448
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 547	EUR 536	09/19/2022	(7,644)
				<u>\$ (1,566,129)</u>
			Wertsteigerung	\$ 3,593
			Wertminderung	\$ (1,569,722)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

VERKAUFTE VERKAUFSoPTIONEN

Bezeichnung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Kontrakte	Prämien erhalten	Marktwert
S&P 500 Index	USD 3,400	10/21/2022	170	\$ 276,585	\$ (321,300)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschlussdatum	Nomineller Betrag (000)	Marktwert	Vorabgebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 27	\$ (11,322)	\$ (4,069)	\$ (7,253)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 529	(221,907)	(79,448)	(142,459)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,008	(841,695)	(294,366)	(547,329)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,057	(862,397)	(236,985)	(625,412)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,466	(319,065)	(169,585)	(149,480)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,199	(478,597)	(224,463)	(254,134)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 589	(128,264)	(44,528)	(83,736)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,466	(319,065)	(188,781)	(130,284)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,833	(398,831)	(96,756)	(302,075)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,833	(398,831)	(107,021)	(291,810)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 873	(365,856)	(157,743)	(208,113)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 900	(377,178)	(166,013)	(211,165)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 1,368	(573,530)	(250,847)	(322,683)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,508	(328,158)	(186,705)	(141,453)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,833	(398,831)	(189,668)	(209,163)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 1,029	(431,522)	(119,335)	(312,187)
Insgesamt				\$ (6,455,049)	\$ (2,516,313)	\$ (3,938,736)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominalbetrag (000)	Abschlussdatum	Zinssatz		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 25,200	04/25/2024	1 Day SOFR	2.703%	\$ 363,373
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 9,060	07/01/2024	1 Day SOFR	3.132%	70,254
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 14,760	04/25/2027	1 Day SOFR	2.774%	218,788
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 11,380	07/01/2027	1 Day SOFR	2.937%	84,196
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 3,370	04/25/2032	1 Day SOFR	2.719%	63,125
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 2,040	07/01/2032	1 Day SOFR	2.914%	5,227
Insgesamt					\$ 804,963
Swaps insgesamt					\$ (3,133,773)

* Kapitalbetrag geringer als 500.

- (a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. August 2022.
- (b) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 31. August 2022.
- (c) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (d) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (e) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (f) Notleidendes fälliges Wertpapier.
- (g) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

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

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS

31. August 2022

AB FCPI

	Dynamic Diversified Portfolio (USD)	Global Equity Blend Portfolio (USD)	Global Value Portfolio (USD)
VERMÖGENSWERTE			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	\$ 34,600,786	\$ 88,307,162	\$ 652,455,665
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	220,360	197,708	2,852,704
Termineinlagen.	1,539,826	3,686,554	8,157,785
Dividenden- und Zinsforderungen	99,196	141,236	1,743,983
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	298,166	501,275	5,461,106
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	364,192	427,254	2,613,519
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	5,448	5,780	2,592,241
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren	28,886	-0-	-0-
Zinsforderungen aus Swaps	5,873	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	79,475	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	45,782	-0-	-0-
Forderungen aus der Wertpapierleihe	-0-	195	2,825
Sonstige Forderungen	32,510	-0-	-0-
	<u>37,320,500</u>	<u>93,267,164</u>	<u>675,879,828</u>
VERBINDLICHKEITEN			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	1,261,044	366,649	5,304,656
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	182,790	-0-	-0-
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	149,721	369,559	3,912,983
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	34,453	-0-	-0-
Zu zahlende Dividenden	-0-	-0-	736,078
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	19,663	60,588	514,431
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	521	138,705	851,128
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten	42,421	-0-	-0-
Zinsaufwand für Swaps	7,702	-0-	-0-
Verkaufte Optionen, zum Marktwert	-0-	-0-	-0-
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	227,508	180,516	772,982
	<u>1,925,823</u>	<u>1,116,017</u>	<u>12,092,258</u>
NETTOVERMÖGEN	<u>\$ 35,394,677</u>	<u>\$ 92,151,147</u>	<u>\$ 663,787,570</u>

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

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)
\$ 517,351,596	\$ 489,953,078	¥ 6,590,599,358	\$ 119,038,227	\$ 460,342,476	\$ 14,439,225,909	\$ 16,636,035,531
111,550	1,716,692	135,316,485	103	1,864,040	618,784,790	1,537,022,252
25,509,376	2,630,269	194,897,247	3,828,179	7,415,418	77,630,769	286,334,160
702,335	952,602	7,632,303	122,124	3,635,806	233,747,183	199,642,885
85,470	2,098,960	106,951,608	1,349,157	8,961,153	169,044,639	127,477,271
676,173	2,585,971	-0-	-0-	4,125,993	62,729,063	183,432,862
3,592,838	1,207,423	1,709,196	1,031,748	912,388	56,518,406	104,738,520
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	91,403,492	57,372,399
-0-	-0-	-0-	-0-	156,437	30,039,998	21,577,441
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	3,905,793	20,764,763
-0-	-0-	-0-	-0-	878,109	742,453	2,921,594
7,564	2,936	70,212	273	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	3,974,538	-0-	-0-	15,445	-0-
<u>548,036,902</u>	<u>501,147,931</u>	<u>7,041,150,947</u>	<u>125,369,811</u>	<u>488,291,820</u>	<u>15,783,787,940</u>	<u>19,177,319,678</u>
757	32,535	7,505,481	849	603,557	641,553,608	1,976,952,793
-0-	-0-	-0-	-0-	723,965	218,736,499	204,394,035
94,787	2,429,119	57,717,221	1,725,986	4,054,843	194,531,997	143,433,509
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	128,449,041	73,659,093
3,548	527,734	6,872,064	196,701	484,573	92,520,912	64,218,752
-0-	-0-	312,407	958,685	707,488	30,709,574	66,773,409
752,652	1,148,727	223,581,473	764,625	1,391,591	23,934,299	31,836,299
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	4,380,433	22,786,528
-0-	-0-	-0-	-0-	45,277	-0-	4,775,730
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
<u>1,086,575</u>	<u>1,669,338</u>	<u>49,078,937</u>	<u>323,120</u>	<u>705,728</u>	<u>27,614,215</u>	<u>21,773,445</u>
<u>1,938,319</u>	<u>5,807,453</u>	<u>345,067,583</u>	<u>3,969,966</u>	<u>8,717,022</u>	<u>1,362,430,578</u>	<u>2,610,603,593</u>
<u>\$ 546,098,583</u>	<u>\$ 495,340,478</u>	<u>¥ 6,696,083,364</u>	<u>\$ 121,399,845</u>	<u>\$ 479,574,798</u>	<u>\$ 14,421,357,362</u>	<u>\$ 16,566,716,085</u>

ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS (Fortsetzung)

31. August 2022

AB FCPI

	European Income Portfolio (EUR)	Emerging Markets Debt Portfolio (USD)	Mortgage Income Portfolio (USD)
VERMÖGENSWERTE			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	€ 1,341,101,524	\$ 471,066,284	\$ 800,380,237
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	2,836,146	2,297,487	1,070,191
Termineinlagen.	43,167,116	12,563,800	34,708,221
Dividenden- und Zinsforderungen	23,232,239	7,766,765	4,766,611
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	24,871,788	6,529,599	3,593
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	16,630,202	16,692,042	8,611,630
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	1,770,531	550,626	777,223
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren	-0-	2,840,992	-0-
Zinsforderungen aus Swaps	138,903	73,915	298,510
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	-0-	222,680	804,963
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	4,633,041	-0-	-0-
Forderungen aus der Wertpapierleihe	-0-	-0-	-0-
Sonstige Forderungen	-0-	-0-	52,585
	<u>1,458,381,490</u>	<u>520,604,190</u>	<u>851,473,764</u>
VERBINDLICHKEITEN			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	6,429,128	6,034,083	6,225,900
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	1,000,795	154,325	3,938,736
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	20,653,067	6,149,093	1,569,722
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	933,420	1,385,261	2,518,357
Zu zahlende Dividenden	7,169,926	1,844,311	2,141,606
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	948,219	1,701	1,825,181
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	4,515,870	1,634,115	1,529,030
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten	2,491,940	86,648	-0-
Zinsaufwand für Swaps	1	81,135	540,275
Verkaufte Optionen, zum Marktwert	-0-	-0-	321,300
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	3,162,623	721,636	1,150,361
	<u>47,304,989</u>	<u>18,092,308</u>	<u>21,760,468</u>
NETTOVERMÖGEN	<u>€ 1,411,076,501</u>	<u>\$ 502,511,882</u>	<u>\$ 829,713,296</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 Jahresabschluss.

**Kombiniert
(USD)**

\$ 36,072,876,362*
2,170,009,493
508,977,501
476,532,328*
347,775,703
299,706,412
173,724,330
151,690,018
52,308,028
25,781,287
9,280,872
14,299
129,156
<u>40,288,805,789*</u>
2,645,542,554
429,353,204
379,666,351
207,005,582
169,678,087*
102,582,262
70,129,925
29,868,528
5,455,119
321,300
59,820,695
<u>4,099,423,607*</u>
<u>\$ 36,189,382,182*</u>

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS
Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2022

AB FCPI

	Dynamic Diversified Portfolio (USD)	Global Equity Blend Portfolio (USD)	Global Value Portfolio (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Zinsen	\$ 271,778	\$ 8,981	\$ 12,978
Swap-Erträge	7,358	-0-	-0-
Dividenden, netto	337,446	1,690,166	17,062,834
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto	-0-	11,748	44,285
	<u>616,582</u>	<u>1,710,895</u>	<u>17,120,097</u>
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	516,477	928,971	5,983,950
Aufwendungen für Swaps	19,574	-0-	-0-
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	39,766	38,661	378,138
Transferstelle	74,716	65,735	173,083
Steuern	19,219	22,590	195,113
Vertriebsgebühr	9,981	7,519	1,441
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	126,648	99,791	208,317
Depotbankgebühren	158,756	29,920	194,924
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	27,601	37,259	109,438
Druckkosten	418	819	12,469
Sonstige Aufwendungen	65,291	39,915	55,880
	<u>1,058,447</u>	<u>1,271,180</u>	<u>7,312,753</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	<u>(339,238)</u>	<u>(108,379)</u>	<u>-0-</u>
Nettoaufwendungen	719,209	1,162,801	7,312,753
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	<u>(102,627)</u>	<u>548,094</u>	<u>9,807,344</u>
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	1,411,057	9,029,262	84,552,071
Kapitalertragsteuer	255	13,270	(48,776)
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	(8,784,973)	(37,431,759)	(250,275,221)
Aus Finanzterminkontrakten	(9,206)	-0-	-0-
Aus Devisentermingeschäften	83,801	4,791	(529,898)
Aus Swaps	(176,899)	-0-	-0-
Aus verkauften Optionen	-0-	-0-	-0-
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	<u>(7,578,592)</u>	<u>(27,836,342)</u>	<u>(156,494,480)</u>
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	(2,348,081)	(16,352,794)	(102,176,142)
Ausschüttungen	-0-	-0-	(8,877,829)
NETTOVERMÖGEN			
Zu Beginn des Geschäftsjahres	45,321,350	136,340,283	931,336,021
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Am Ende des Geschäftsjahres	<u>\$ 35,394,677</u>	<u>\$ 92,151,147</u>	<u>\$ 663,787,570</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 Jahresabschluss.

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)
\$ 13,984	\$ 1,306	\$ 8,688	¥ -0-	\$ 15,360	\$ 17,162,062	\$ 1,215,378,890
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	1,157,373	166,650,378
10,878,566	1,750,150	13,215,260	179,219,968	2,870,604	-0-	40,386,788
70,774	23,479	14,124	1,029,396	7,886	-0-	-0-
10,963,324	1,774,935	13,238,072	180,249,364	2,893,850	18,319,435	1,422,416,056
9,617,233	4,706,905	4,459,552	60,854,963	1,698,970	3,050,162	233,450,430
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	890,520	28,258,242
578,859	196,725	136,180	1,969,620	46,585	412,983	15,553,416
275,442	131,394	165,875	2,148,477	75,514	224,421	9,645,544
278,165	206,707	145,468	1,924,236	45,283	207,056	7,404,756
32,719	21,691	162,281	7,063	7,201	831	11,107,086
271,587	80,030	194,135	39,631,602	109,933	346,256	1,224,610
202,903	-0-	159,420	9,339,100	62,193	133,502	974,280
92,707	58,305	72,042	4,104,233	40,049	81,899	212,377
13,275	737	34,536	813,159	6,272	19,511	192,870
179,948	16,379	93,352	17,115,402	50,174	85,618	1,016,382
11,542,838	5,418,873	5,622,841	137,907,855	2,142,174	5,452,759	309,039,993
-0-	-0-	(1)	(58,819,677)	(108,066)	(132,288)	-0-
11,542,838	5,418,873	5,622,840	79,088,178	2,034,108	5,320,471	309,039,993
(579,514)	(3,643,938)	7,615,232	101,161,186	859,742	12,998,964	1,113,376,063
(34,978,905)	103,283,944	(552,889)	652,769,452	(8,942,667)	2,187,828	(1,151,851,543)
(3,824)	-0-	(584,936)	-0-	-0-	-0-	237,029
(133,048,892)	(209,432,087)	(104,880,376)	(190,529,436)	(35,772,180)	(40,035,319)	(2,724,647,492)
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	1,544,692	(6,267,472)
(58,258)	(205,943)	(1,317,729)	45,598,482	(1,028,643)	1,661,213	(61,849,211)
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	(1,011,893)	13,303,739
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	385,098
(168,669,393)	(109,998,024)	(99,720,698)	608,999,684	(44,883,748)	(22,654,515)	(2,817,313,789)
(27,132,456)	(867,655,502)	227,644,805	(2,319,880,503)	15,291,999	(22,879,801)	(2,333,422,005)
(57,693)	-0-	(6,432,742)	(76,036,182)	(2,605,478)	(6,175,227)	(1,233,852,758)
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-
\$ 546,098,583	\$ -0-	\$ 495,340,478	¥ 6,696,083,364	\$ 121,399,845	\$ 479,574,798	\$ 14,421,357,362

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS**(Fortsetzung)****Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2022****AB FCPI**

	American Income Portfolio (USD)	European Income Portfolio (EUR)	Emerging Markets Debt Portfolio (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Zinsen	\$ 1,093,601,849	€ 92,030,547	\$ 44,958,537
Swap-Erträge	129,203,251	447,136	57,972
Dividenden, netto	33,881,711	-0-	10,479
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto	-0-	-0-	-0-
	<u>1,256,686,811</u>	<u>92,477,683</u>	<u>45,026,988</u>
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	194,482,224	17,348,570	5,191,121
Aufwendungen für Swaps	30,263,372	134,576	810,572
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	17,587,689	1,597,837	247,414
Transferstelle	9,297,316	415,685	233,068
Steuern	8,341,684	769,057	230,300
Vertriebsgebühr	6,531,694	36,677	139,447
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	1,462,460	387,335	327,512
Depotbankgebühren	906,177	36,262	133,704
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	212,377	210,887	96,342
Druckkosten	326,453	3,764	6,036
Sonstige Aufwendungen	1,207,757	165,639	108,422
	<u>270,619,203</u>	<u>21,106,289</u>	<u>7,523,938</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	(159)	-0-	-0-
Nettoaufwendungen	270,619,044	21,106,289	7,523,938
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	<u>986,067,767</u>	<u>71,371,394</u>	<u>37,503,050</u>
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	(1,225,239,270)	88,396,869	(92,359,433)
Kapitalertragsteuer	-0-	-0-	-0-
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	(2,873,187,184)	(183,101,399)	(145,504,505)
Aus Finanzterminkontrakten	(19,061,167)	(6,657,549)	(86,648)
Aus Devisentermingeschäften	(14,957,715)	8,473,305	(3,495,607)
Aus Swaps	196,738,540	(1,000,795)	1,701,659
Aus verkauften Optionen	2,347,748	(492,233)	-0-
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	<u>(2,947,291,281)</u>	<u>(23,010,408)</u>	<u>(202,241,484)</u>
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
(Minderung)	(4,488,398,526)	(736,364,250)	(139,076,763)
Ausschüttungen	(835,033,647)	(75,045,195)	(26,288,517)
NETTOVERMÖGEN			
Zu Beginn des Geschäftsjahres	24,837,439,539	2,245,496,354	870,118,646
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Am Ende des Geschäftsjahres	<u>\$ 16,566,716,085</u>	<u>€ 1,411,076,501</u>	<u>\$ 502,511,882</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 Jahresabschluss.

Mortgage Income Portfolio (USD)	Kombiniert (USD)
\$ 83,138,392	\$ 2,555,991,407
1,741,104	299,431,309
-0-	115,511,073*
-0-	180,737
<u>84,879,496</u>	<u>2,971,114,526*</u>
8,713,870	492,392,635
564,370	61,053,345
413,629	37,400,409
400,992	21,238,032
395,900	18,353,021
1,865	18,064,048
312,141	5,543,845
178,449	3,272,925
136,890	1,455,259
10,931	641,871
138,582	3,414,735
<u>11,267,619</u>	<u>662,830,125</u>
(1,977)	(1,172,429)
<u>11,265,642</u>	<u>661,657,696</u>
<u>73,613,854</u>	<u>2,309,456,830*</u>
(66,940,168)	(2,278,617,916)
-0-	(386,982)
(43,994,147)	(6,830,753,384)*
-0-	(31,281,432)
(2,382,470)	(74,355,228)
5,753,275	214,903,988
(44,715)	2,148,151
<u>(33,994,371)</u>	<u>(6,688,885,973)*</u>
(595,593,445)	(8,920,573,304)*
(34,471,801)	(2,229,099,676)*
1,493,772,913	54,360,039,002
-0-	(332,097,867)*
<u>\$ 829,713,296</u>	<u>\$ 36,189,382,182*</u>

KLASSE	Dynamic Diversified Portfolio	Global Equity Blend Portfolio	Global Value Portfolio
A	230,446	545,747	2,680,672
A EUR	22,605	18,259	245,213
A EUR H	35,151	197,682	-0-
A SGD	-0-	64,222	3,769,430
A SGD H	-0-	-0-	402,935
AD	-0-	-0-	1,545,256
AD AUD H	-0-	-0-	2,276,894
AD CAD H	-0-	-0-	339,715
AD EUR H	-0-	-0-	65,381
AD GBP H	-0-	-0-	244,212
AD HKD	-0-	-0-	853,342
AD ZAR H	-0-	-0-	857,820
AX	495,131	-0-	-0-
AX EUR	1,701	-0-	-0-
AX SGD	11,001	-0-	-0-
B	-0-	22,329	8,264
B SGD	-0-	6,384	-0-
BX	41,126	-0-	-0-
BX SGD	16	-0-	-0-
C	94,284	150,870	184,289
C EUR	2,903	52	5,316
C EUR H	49	-0-	-0-
CX	57,651	-0-	-0-
I	490,848	64,287	1,518,990
I EUR	18,707	15,870	456
I EUR H	105,401	-0-	-0-
I GBP	-0-	-0-	493
I SGD	-0-	-0-	253,106
IX	1,609	-0-	-0-
S	-0-	-0-	3,338,767
S GBP	-0-	-0-	3,128
S GBP H	-0-	-0-	683,650
S HKD	-0-	419,387	-0-
S1	-0-	235,930	10,297,071
S1 EUR	-0-	272	360
S1 GBP	-0-	277	4,666
S1 SGD	-0-	1,593,865	-0-
SD	-0-	-0-	1,173,812

KLASSE	Emerging Markets Growth Portfolio	Asia Ex-Japan Equity Portfolio	Japan Strategic Value Portfolio
A.....	10,021,007	563,898	29,004
A AUD H.....	152,984	240,136	-0-
A CZK H.....	-0-	-0-	397
A EUR.....	107,855	9,187,010	6,677
A EUR H.....	-0-	-0-	18,812
A HKD.....	11,250	99,470	-0-
A PLN.....	-0-	-0-	90
A PLN H.....	10,434	-0-	-0-
A SGD.....	1,467	-0-	791
A SGD H.....	2,373	3,953	1,164
A USD.....	-0-	-0-	24,406
A USD H.....	-0-	-0-	121,235
AD.....	10,485	1,773,787	11,732
AD AUD H.....	-0-	2,406,055	316,152
AD CAD H.....	-0-	596,540	-0-
AD EUR.....	-0-	48,448	-0-
AD EUR H.....	-0-	30,132	-0-
AD GBP H.....	-0-	272,997	-0-
AD HKD.....	-0-	953,246	-0-
AD NZD H.....	-0-	469,239	37,014
AD RMB H.....	-0-	1,044	-0-
AD USD H.....	-0-	-0-	64,123
AD ZAR H.....	-0-	2,126,657	42,452
AY JPY.....	-0-	116,882,118	-0-
B.....	16,773	-0-	-0-
BD.....	-0-	3,164	-0-
BD AUD H.....	-0-	12,468	-0-
BD HKD.....	-0-	1,369	-0-
BY JPY.....	-0-	979,900,001	-0-
C.....	205,137	3,115	232
C EUR.....	2,962	22,902	147
C EUR H.....	-0-	-0-	521
C USD.....	-0-	-0-	773
ED.....	123,097	202,365	-0-
ED AUD H.....	-0-	4,492	-0-
I.....	879,181	1,091,295	359
I AUD H.....	1,495	761	-0-
I EUR.....	161,288	5,830	2,903
I EUR H.....	-0-	-0-	367
I GBP.....	-0-	383	-0-
I SGD.....	-0-	-0-	100
I USD.....	-0-	-0-	13,488
I USD H.....	-0-	-0-	15,862
N.....	27,487	-0-	-0-
S.....	-0-	530,928	-0-
S EUR H.....	-0-	-0-	421
S HKD.....	-0-	402,147	-0-
S1.....	907,784	3,141,909	-0-
S1 EUR.....	128	311	74
S1 GBP.....	131	-0-	-0-
S1 USD.....	-0-	-0-	200,233
SD.....	-0-	473,272	95,496

UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

31. August 2022

AB FCPI

KLASSE	China Low Volatility Equity Portfolio	Short Duration Bond Portfolio	Global High Yield Portfolio
A.....	611,076	2,635,704	131,870,463
A EUR.....	22,612	65,650	1,789,278
A HKD.....	30,975	-0-	-0-
A PLN H.....	29,301	-0-	-0-
A2.....	-0-	9,348,739	43,135,897
A2 CHF H.....	-0-	-0-	586,458
A2 EUR.....	-0-	126,580	672,638
A2 EUR H.....	-0-	5,509	1,463,150
A2 HKD.....	-0-	39,246	436,089
A2 PLN H.....	-0-	-0-	328,216
A2 SGD.....	-0-	-0-	3,947
A2 SGD H.....	-0-	-0-	683,807
AA.....	-0-	261,585	298,043,298
AA AUD H.....	-0-	922,051	145,588,561
AA CAD H.....	-0-	618,207	1,201,743
AA EUR H.....	-0-	-0-	2,038,467
AA GBP H.....	-0-	251,218	4,844,518
AA HKD.....	-0-	482,383	12,488,744
AA NZD H.....	-0-	-0-	2,186,626
AA RMB H.....	-0-	-0-	4,043,021
AA SGD H.....	-0-	37,318	1,773,135
AA ZAR H.....	-0-	-0-	246,194,725
AD.....	489,918	-0-	-0-
AD AUD H.....	1,264,732	-0-	-0-
AD CAD H.....	80,772	-0-	-0-
AD EUR H.....	19,780	-0-	-0-
AD GBP H.....	51,086	-0-	-0-
AD HKD.....	192,140	-0-	-0-
AD NZD H.....	89,911	-0-	-0-
AD SGD H.....	2,443	-0-	-0-
AD ZAR H.....	2,980,257	-0-	-0-
AJ.....	-0-	3,985,607	-0-
AK.....	-0-	-0-	16,293
AK EUR.....	-0-	-0-	112,317
AK EUR H.....	-0-	-0-	3,678
AR EUR H.....	-0-	-0-	53,247
AT.....	-0-	5,891,457	1,368,321,417
AT AUD H.....	-0-	315,165	77,534,005
AT CAD H.....	-0-	58,796	7,801,443
AT EUR.....	-0-	52,934	8,777,779
AT EUR H.....	-0-	16,063	5,509,643
AT GBP H.....	-0-	79,149	3,936,008
AT HKD.....	-0-	213,065	101,339,600
AT NZD H.....	-0-	57,794	11,261,619
AT RMB H.....	-0-	-0-	2,724,336
AT SGD.....	-0-	-0-	3,344,256
AT SGD H.....	-0-	26,365	19,652,573
AX.....	-0-	15,442	-0-
B.....	15,667	7,300	803,432
B EUR.....	293	-0-	-0-
B2.....	-0-	-0-	10,856
BA.....	-0-	-0-	3,024
BA AUD H.....	-0-	-0-	1,444
BD NZD H.....	1,248	-0-	-0-
BT.....	-0-	-0-	403,274
BT AUD H.....	-0-	-0-	48,930
BT HKD.....	-0-	-0-	2,875
BT NZD H.....	-0-	-0-	219

KLASSE	China Low Volatility Equity Portfolio	Short Duration Bond Portfolio	Global High Yield Portfolio
C.....	7,350	248,433	18,477,428
C EUR.....	2,772	-0-	10,919
C2.....	-0-	324,552	1,881,591
C2 EUR.....	-0-	-0-	5,401
C2 EUR H.....	-0-	457	10,524
CK.....	-0-	-0-	1,096
CK EUR H.....	-0-	-0-	739
CT.....	-0-	-0-	19,083
EA.....	-0-	-0-	154,990,712
EA AUD H.....	-0-	-0-	10,693,898
EA ZAR H.....	-0-	-0-	24,756,160
I.....	41,613	1,048,852	25,132,706
I EUR.....	292	1,292	125,188
I2.....	-0-	4,050,633	10,972,527
I2 AUD H.....	-0-	-0-	4,448
I2 CHF H.....	-0-	-0-	34,568
I2 EUR.....	-0-	9,907	31,418
I2 EUR H.....	-0-	343,758	1,057,871
I2 SGD.....	-0-	-0-	31,721
I2 SGD H.....	-0-	-0-	28,547
IA AUD H.....	-0-	-0-	233,412
IQD.....	-0-	-0-	20,184
IQD EUR.....	-0-	-0-	569
IT.....	-0-	197,629	3,441,321
IT AUD H.....	-0-	-0-	759,986
IT CAD H.....	-0-	-0-	65,958
IT EUR H.....	-0-	-0-	23,691
IT GBP H.....	-0-	-0-	226,791
IT HKD.....	-0-	-0-	49,439
IT RMB H.....	-0-	-0-	11,385
J.....	-0-	-0-	4,192,787
N2.....	-0-	117,595	428,768
NT.....	-0-	156,891	1,557,657
S.....	191,719	711,872	-0-
S1.....	552,336	-0-	15,933,252
S1 2.....	-0-	2,375,648	-0-
S1 2 EUR.....	-0-	567	-0-
S1 EUR.....	98	-0-	320
S1D.....	-0-	-0-	43,092,274
SA.....	-0-	127,471	552,566
SHK.....	-0-	-0-	196,881
SK.....	-0-	-0-	10,352,022
W.....	-0-	-0-	90,225
W EUR.....	-0-	-0-	713
W2.....	-0-	-0-	175,657
W2 CHF H.....	-0-	-0-	7,008
W2 EUR H.....	-0-	-0-	15,731
WT.....	-0-	-0-	173,822
WT AUD H.....	-0-	-0-	179,205
WT CAD H.....	-0-	-0-	129,899
WT EUR H.....	-0-	-0-	223,202
WT GBP H.....	-0-	-0-	14,551
WT RMB H.....	-0-	-0-	59,816

UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

31. August 2022

AB FCPI

	American Income Portfolio	European Income Portfolio	Emerging Markets Debt Portfolio
KLASSE			
A.....	154,776,353	2,101,147	932,198
A EUR.....	686,326	-0-	560
A USD.....	-0-	358,982	-0-
A2.....	53,605,981	2,850,478	416,887
A2 CHF H.....	441,296	8,545	600
A2 DUR PH.....	3,867	-0-	-0-
A2 EUR.....	1,228,166	-0-	172,141
A2 EUR H.....	1,575,591	-0-	35,372
A2 HKD.....	507,309	-0-	8,825
A2 PLN.....	-0-	-0-	3,502
A2 PLN H.....	641,910	1,323	94,306
A2 SGD.....	8,088	-0-	-0-
A2 SGD H.....	701,539	-0-	225,669
A2 USD.....	-0-	262,957	-0-
A2 USD H.....	-0-	369,853	-0-
AA.....	86,946,345	1,659,498	3,855,215
AA AUD H.....	29,864,559	9,541,340	2,625,194
AA CAD H.....	3,481,577	-0-	6,390
AA DUR PH.....	715,765	-0-	-0-
AA EUR H.....	1,273,105	-0-	1,197
AA GBPH.....	7,988,865	-0-	2,880
AA HKD.....	24,672,342	-0-	142,115
AA HKD H.....	-0-	4,726,924	-0-
AA NZD H.....	4,176,332	-0-	44,729
AA RMB H.....	5,501,209	587,926	1,224
AA SGD H.....	2,275,343	82,957	1,430
AA USD H.....	-0-	41,865,578	-0-
AA ZAR H.....	17,107,423	-0-	7,326,253
AI.....	-0-	-0-	11,197
AI AUD H.....	-0-	-0-	1,059
AK.....	36,385	110,361	-0-
AK EUR.....	36,337	-0-	-0-
AK EUR H.....	20,385	-0-	-0-
AR.....	-0-	2,443,780	-0-
AR EUR.....	5,797	-0-	800
AR EUR H.....	13,615	-0-	-0-
AT.....	688,189,497	13,630,077	6,841,577
AT AUD H.....	73,504,914	4,798,943	4,558,617
AT CAD H.....	19,447,111	-0-	137,317
AT DUR PH.....	55,711	-0-	-0-
AT EUR.....	5,337,301	-0-	55,163
AT EUR H.....	6,823,366	-0-	229,174
AT GBPH.....	13,940,797	-0-	29,330
AT HKD.....	189,698,555	-0-	543,124
AT NZD H.....	11,117,886	-0-	464,783
AT RMB H.....	3,355,509	-0-	-0-
AT SGD.....	1,226,391	-0-	-0-
AT SGD H.....	28,408,269	677,043	239,334
AT USD.....	-0-	628,765	-0-
AT USD H.....	-0-	14,154,035	-0-
B.....	728,466	-0-	-0-
B USD.....	-0-	127,696	-0-
B2.....	41,003	680	-0-
B2 HKD.....	4,085	-0-	1,115
B2 USD.....	-0-	1,300	-0-
BA.....	138,333	-0-	-0-
BA AUD H.....	44,521	73,337	-0-
BA USD H.....	-0-	24,594	-0-
BT.....	1,595,114	1,102	31,116

KLASSE	American Income Portfolio	European Income Portfolio	Emerging Markets Debt Portfolio
BT AUD H	362,962	8,063	-0-
BT CAD H	129,402	-0-	-0-
BT EUR H	40,773	-0-	-0-
BT GBP H	74,224	-0-	-0-
BT HKD	651,228	-0-	-0-
BT NZD H	73,525	-0-	-0-
BT USD H	-0-	31,630	-0-
C	22,013,073	669,968	217,972
C EUR	11,325	-0-	1,054
C USD	-0-	142,473	-0-
C2	5,833,453	53,247	87,870
C2 DUR PH	5,515	-0-	-0-
C2 EUR	64,735	-0-	843
C2 EUR H	8,805	-0-	541
C2 USD	-0-	9,584	-0-
C2 USD H	-0-	140,922	-0-
CK	-0-	9,011	-0-
CT	152,639	-0-	1,072
CT USD H	-0-	40,630	-0-
EA	28,358,860	-0-	835,571
EA AUD H	3,602,348	-0-	175,647
EA ZAR H	4,369,722	-0-	407,708
EI	-0-	-0-	168,124
EI AUD H	-0-	-0-	8,615
I	43,719,131	738,715	538,686
I EUR	71,136	-0-	-0-
I USD	-0-	276,577	-0-
I2	45,218,491	6,292,116	159,171
I2 AUD H	3,339,487	199,661	291,808
I2 CHF H	381,534	633	600
I2 DUR PH	1,900	-0-	-0-
I2 EUR	3,181,757	-0-	1,464
I2 EUR H	1,824,051	-0-	3,449,512
I2 HKD	135,706	-0-	-0-
I2 SGD	498	-0-	-0-
I2 SGD H	87,002	-0-	-0-
I2 USD	-0-	26,112	-0-
I2 USD H	-0-	247,634	-0-
IA	512,155	84,489	-0-
IA AUD H	3,503,664	-0-	-0-
IA HKD H	-0-	1,189	-0-
IA SGD H	-0-	1,434	-0-
IA USD H	-0-	126,794	-0-
IT	30,358,077	91,232	-0-
IT AUD H	371,917	-0-	1,876
IT CAD H	477,475	-0-	-0-
IT EUR H	211,228	-0-	1,333,333
IT GBP H	284,958	-0-	-0-
IT HKD	115,910	-0-	-0-
IT JPY	271,101	-0-	-0-
IT JPY H	267,361	-0-	-0-
IT NZD H	34,134	-0-	-0-
IT RMB H	50,667	-0-	-0-
IT SGD	31,898	-0-	-0-
IT SGD H	1,001,939	1,354	-0-
IT USD H	-0-	143,545	-0-
J	68,173,276	-0-	-0-
L2	3,333	-0-	-0-
LT	3,883	-0-	-0-

KLASSE	American Income Portfolio	European Income Portfolio	Emerging Markets Debt Portfolio
N2.....	4,080,386	-0-	10,557
NT.....	2,694,214	-0-	68,045
NT USD H.....	-0-	54,882	-0-
S.....	1,682,639	-0-	275
S1.....	50,623,398	257,998	-0-
S1 2.....	-0-	-0-	3,971,735
S1 2 EUR.....	-0-	-0-	266
S1 EUR.....	14,483	-0-	-0-
S1 EUR H.....	-0-	-0-	521
S1 GBP H.....	-0-	-0-	431
S1 USD.....	-0-	349	-0-
S1 USD H.....	-0-	7,923,448	-0-
S1D.....	29,579,010	929,297	-0-
S1D2.....	342,713	-0-	-0-
SA.....	3,951,333	-0-	862,683
SA USD H.....	-0-	890,142	-0-
SHK.....	1,308,637	146,992	-0-
W.....	860,164	-0-	-0-
W2.....	4,101,425	936,645	-0-
W2 CHF H.....	135,581	150,491	-0-
W2 EUR H.....	179,335	-0-	-0-
W2 USD H.....	-0-	4,667	-0-
WA.....	-0-	203,323	-0-
WA HKD H.....	-0-	946	-0-
WA USD H.....	-0-	589,208	-0-
WT.....	2,380,306	100,461	-0-
WT AUD H.....	582,131	-0-	-0-
WT EUR H.....	241,935	-0-	-0-
WT GBP H.....	53,221	-0-	-0-
WT HKD.....	235,115	-0-	-0-
WT SGD H.....	384,167	1,078	-0-
WT USD H.....	-0-	4,151	-0-

KLASSE	Mortgage Income Portfolio
A.....	8,501,516
A2.....	5,106,420
A2 EUR.....	19,523
A2 HKD.....	4,108
A2 SGD.....	565
A2X.....	257,641
A2X EUR.....	24,944
AA.....	7,815,667
AA AUD H.....	3,507,408
AA HKD.....	4,714,654
AA RMB H.....	675,149
AA SGD H.....	66,253
AA ZAR H.....	1,619,935
AR EUR H.....	7,017
AT.....	2,550,374
AT AUD H.....	736,298
AT EUR.....	18,258
AT GBP H.....	9,851
AT HKD.....	73,342
AT SGD.....	838
AT SGD H.....	37,078
AX.....	447,473
AX EUR.....	3,524
BX.....	61,143
BX EUR.....	3,298
C.....	1,556,820
C2.....	1,309,525
C2 EUR.....	507
CX.....	16,088
I.....	3,961,964
I EUR.....	3,381
I2.....	7,189,127
I2 EUR.....	4,823
I2 EUR H.....	458,772
IT EUR H.....	3,471
IX.....	89,248
N2.....	448,053
NT.....	399,351
S.....	1,177
S1.....	10,272,448
S1 EUR.....	541
S1 EUR H.....	90
S1 JPY.....	1,618
SA.....	329,256

	Dynamic Diversified Portfolio		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen.....	\$ 35,394,677	\$ 45,321,350	\$ 42,312,154
Klasse			
A	\$ 20.28	\$ 24.23	\$ 20.37
A EUR	€ 20.18	€ 20.52	€ 17.07
A EUR H	€ 17.41	€ 21.21	€ 18.04
AX	\$ 24.45	\$ 29.21	\$ 24.54
AX EUR	€ 24.33	€ 24.73	€ 20.57
AX SGD	SGD34.20	SGD39.30	N/A
B	N/A	N/A	\$ 18.54
BX	\$ 20.49	\$ 24.71	\$ 20.98
BX SGD	SGD28.69	SGD33.27	N/A
C	\$ 19.70	\$ 23.61	\$ 19.91
C EUR	€ 19.60	€ 20.00	€ 16.69
C EUR H	€ 16.89	€ 20.68	€ 17.65
CX	\$ 23.30	\$ 27.91	\$ 23.53
I	\$ 21.79	\$ 25.86	\$ 21.59
I EUR	€ 21.68	€ 21.90	€ 18.10
I EUR H	€ 18.71	€ 22.63	€ 19.12
IX	\$ 27.46	\$ 32.57	\$ 27.18
S1 EUR H (1)	N/A	€ 23.91	€ 20.11

	Global Equity Blend Portfolio		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen.....	\$ 92,151,147	\$ 136,340,283	\$ 106,438,986
Klasse			
A	\$ 23.07	\$ 29.48	\$ 21.89
A EUR	€ 22.96	€ 24.97	€ 18.35
A EUR H	€ 20.21	€ 26.48	€ 19.91
A SGD	SGD32.27	SGD39.67	N/A
B	\$ 19.08	\$ 24.63	\$ 18.47
B SGD	SGD26.69	SGD33.14	N/A
C	\$ 21.41	\$ 27.48	\$ 20.49
C EUR (2)	€ 13.54	€ 23.28	€ 17.17
I	\$ 26.94	\$ 34.15	\$ 25.15
I EUR	€ 26.80	€ 28.92	€ 21.08
S	N/A	N/A	\$ 30.16
S HKD	HKD259.26	HKD321.85	N/A
S1	\$ 29.40	\$ 37.09	\$ 27.22
S1 EUR	€ 29.25	€ 31.41	€ 22.81
S1 GBP	£ 25.31	£ 26.98	N/A
S1 SGD	SGD41.12	SGD49.91	N/A

	Global Value Portfolio		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen.....	\$ 663,787,570	\$ 931,336,021	\$ 366,088,109
Klasse			
A	\$ 18.03	\$ 22.10	\$ 16.51
A EUR	€ 17.93	€ 18.72	€ 13.84
A SGD	SGD25.21	SGD29.74	N/A
A SGD H	SGD18.12	SGD22.33	SGD16.74
AD	\$ 13.22	\$ 16.83	\$ 13.04
AD AUD H	AUD12.02	AUD15.52	AUD12.18
AD CAD H	CAD12.40	CAD15.90	CAD12.43
AD EUR H	€ 12.90	€ 16.58	€ 12.93
AD GBP H	£ 12.38	£ 15.93	£ 12.48
AD HKD	HKD103.82	HKD130.89	N/A
AD SGD H (3)	N/A	SGD16.49	SGD12.82
AD ZAR H	R82.05	R105.47	R81.72
B	\$ 14.59	\$ 18.07	\$ 13.63
BD (4)	N/A	\$ 17.13	\$ 13.30
BD AUD H	N/A	N/A	AUD12.25
BD EUR H	N/A	N/A	€ 12.96
BD ZAR H	N/A	N/A	R82.18
C	\$ 16.55	\$ 20.38	\$ 15.29
C EUR	€ 16.46	€ 17.26	€ 12.82
I	\$ 21.23	\$ 25.82	\$ 19.13
I EUR	€ 21.13	€ 21.86	€ 16.03
I GBP (5)	£ 14.63	N/A	N/A
I SGD	SGD29.69	SGD34.74	N/A
S	\$ 25.06	\$ 30.21	\$ 22.18
S GBP	£ 21.59	£ 21.99	N/A
S GBP H	£ 19.42	£ 23.67	£ 17.55
S1	\$ 22.37	\$ 27.16	\$ 20.08
S1 EUR	€ 22.26	€ 23.00	€ 16.83
S1 GBP	£ 19.26	£ 19.76	N/A
SD	\$ 89.62	\$ 113.75	\$ 87.93

	Emerging Markets Growth Portfolio		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen.....	\$ 546,098,583	\$ 741,958,125	\$ 783,098,409
Klasse			
A	\$ 42.46	\$ 55.85	\$ 47.83
A AUD H	AUD18.31	AUD24.54	AUD21.28
A EUR	€ 42.24	€ 47.29	€ 40.09
A HKD	HKD333.27	HKD434.41	N/A
A PLN H	PLN94.78	PLN124.64	PLN108.36
A SGD	SGD59.38	SGD75.15	N/A
A SGD H	SGD14.42	SGD19.07	SGD16.40
AD	\$ 15.78	\$ 21.42	\$ 18.84
B	\$ 31.72	\$ 42.14	\$ 36.45
C	\$ 34.77	\$ 45.94	\$ 39.52
C AUD H (6)	N/A	AUD23.10	AUD20.13
C EUR	€ 34.59	€ 38.91	€ 33.12
ED	\$ 11.34	\$ 15.41	\$ 13.59
I	\$ 52.07	\$ 67.94	\$ 57.72
I AUD H	AUD19.98	AUD26.53	AUD22.82
I EUR	€ 51.80	€ 57.54	€ 48.38
N	\$ 20.81	\$ 27.50	\$ 23.65
S (7)	N/A	\$ 81.32	\$ 68.35
S1	\$ 54.26	\$ 70.69	\$ 59.95
S1 EUR	€ 54.03	€ 59.87	€ 50.25
S1 GBP	£ 46.77	£ 51.44	N/A

	Sustainable US Thematic Portfolio*		
	28. Januar 2022	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	AUD70.18	AUD77.84	AUD58.29
A CAD H	CAD64.92	CAD71.82	CAD53.68
A EUR	€ 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	HKD315.78	HKD348.44	N/A
A SGD H	SGD52.47	SGD58.00	SGD43.26
AN	\$ 78.09	\$ 86.34	\$ 64.25
B	\$ 33.05	\$ 36.69	\$ 27.57
C	\$ 38.35	\$ 42.48	\$ 31.76
C EUR	€ 34.40	€ 35.98	€ 26.62
C EUR H	€ 60.37	€ 67.10	€ 50.73
C SGD	SGD52.07	SGD57.17	N/A
E	\$ 15.08	\$ 16.74	N/A
I	\$ 48.00	\$ 52.90	\$ 39.05
I EUR	€ 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	€ 76.84	€ 79.95	€ 58.41
S	\$ 65.60	\$ 72.04	\$ 52.74
S1	\$ 50.69	\$ 55.82	\$ 41.13
S1 EUR	€ 45.46	€ 47.27	€ 34.47
S1 JPY H	¥ 472.00	¥ 520.00	¥ 385.00

	Asia Ex-Japan Equity Portfolio		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen.....	\$ 495,340,478	\$ 373,849,113	\$ 299,846,609
Klasse			
A	\$ 21.89	\$ 27.61	\$ 20.88
A AUD H	AUD21.66	AUD27.70	AUD21.25
A EUR	€ 21.77	€ 23.38	€ 17.50
A HKD	HKD171.82	HKD214.74	N/A
A SGD H	SGD15.69	SGD19.86	SGD15.10
AD	\$ 13.74	\$ 17.93	\$ 14.00
AD AUD H	AUD11.75	AUD15.54	AUD12.32
AD CAD H	CAD10.04	CAD13.21	CAD10.41
AD EUR	€ 13.71	€ 15.18	€ 11.73
AD EUR H	€ 12.46	€ 16.40	€ 12.92
AD GBP H	£ 12.39	£ 16.34	£ 12.90
AD HKD	HKD107.91	HKD139.44	N/A
AD NZD H	NZD12.84	NZD16.92	NZD13.36
AD RMB H	CNH85.40	CNH111.59	CNH87.37
AD SGD H (8)	N/A	SGD17.08	SGD13.41
AD ZAR H	R90.69	R119.83	R93.89
AY JPY	¥ 2.19	¥ 2.19	¥ 1.59
BD	\$ 13.65	\$ 17.83	\$ 13.96
BD AUD H	AUD11.74	AUD15.56	AUD12.36
BD CAD H (9)	N/A	CAD13.80	CAD10.89
BD GBP H	N/A	N/A	£ 12.94
BD HKD	HKD107.18	HKD138.72	N/A
BD NZD H (10)	N/A	NZD16.82	NZD13.30
BD ZAR H (11)	N/A	R107.61	R84.35
BY JPY	¥ 2.08	¥ 2.09	¥ 1.53
C	\$ 20.67	\$ 26.19	\$ 19.90
C AUD H (12)	N/A	AUD26.85	AUD20.68
C EUR	€ 20.57	€ 22.17	€ 16.68
ED	\$ 11.79	\$ 15.36	\$ 11.99
ED AUD H (13)	AUD13.98	N/A	N/A
I	\$ 24.25	\$ 30.34	\$ 22.76
I AUD H	AUD24.34	AUD30.88	AUD23.50
I EUR	€ 24.13	€ 25.70	€ 19.08
I GBP	£ 23.45	£ 24.79	£ 19.12
ID (14)	N/A	\$ 17.97	\$ 14.02
ID AUD H (15)	N/A	AUD15.83	AUD12.54
S	\$ 27.85	\$ 34.48	\$ 25.59
S HKD	HKD218.61	HKD268.21	N/A
S1	\$ 24.78	\$ 30.96	\$ 23.18
S1 EUR	€ 24.66	€ 26.22	€ 19.43
SD	\$ 94.48	\$ 123.26	\$ 96.21

	Japan Strategic Value Portfolio		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen.....	¥ 6,696,083,364	¥ 8,483,000,365	¥ 8,665,430,416
Klasse			
2.....	N/A	N/A	¥10,390.00
A.....	¥ 12,031.00	¥ 11,676.00	¥ 9,542.00
A AUD H (16).....	N/A	AUD22.71	AUD18.72
A CZK H.....	CZK1,009.83	CZK952.60	CZK784.96
A EUR.....	€ 86.22	€ 89.97	€ 75.53
A EUR H.....	€ 27.64	€ 27.12	€ 22.39
A NZD H (17).....	N/A	NZD24.85	NZD20.39
A PLN.....	PLN407.17	PLN406.65	N/A
A SGD.....	SGD121.07	SGD142.75	N/A
A SGD H.....	SGD17.29	SGD16.72	SGD13.67
A USD.....	\$ 86.63	\$ 106.17	\$ 90.05
A USD H.....	\$ 34.28	\$ 33.08	\$ 27.00
AD.....	¥ 11,876.00	¥ 11,823.00	¥ 9,930.00
AD AUD H.....	AUD15.49	AUD15.58	AUD13.24
AD NZD H.....	NZD15.97	NZD16.06	NZD13.60
AD USD H.....	\$ 15.52	\$ 15.48	\$ 13.04
AD ZAR H.....	R109.05	R108.96	R91.42
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 (18).....	N/A	AUD15.40	AUD13.10
BD USD H.....	N/A	N/A	\$ 12.93
BD ZAR H.....	N/A	N/A	R91.01
C.....	¥ 11,128.00	¥ 10,880.00	¥ 8,941.00
C EUR.....	€ 79.82	€ 83.88	€ 70.77
C EUR H.....	€ 25.81	€ 25.51	€ 21.15
C USD.....	\$ 80.16	\$ 98.97	\$ 84.38
I.....	¥ 13,666.00	¥ 13,154.00	¥ 10,672.00
I EUR.....	€ 98.03	€ 101.40	€ 84.48
I EUR H.....	€ 30.46	€ 29.65	€ 24.28
I SGD.....	SGD137.54	SGD160.88	N/A
I USD.....	\$ 98.42	\$ 119.65	\$ 100.72
I USD H.....	\$ 37.36	\$ 35.77	\$ 28.97
S EUR H.....	€ 30.46	€ 29.38	€ 23.77
S1.....	N/A	N/A	¥ 11,257.00
S1 EUR.....	€ 104.16	€ 107.51	€ 89.11
S1 USD.....	\$ 104.61	\$ 126.86	\$ 106.24
S1 USD H (19).....	N/A	\$ 25.78	\$ 20.76
SD.....	¥ 12,939.00	¥ 12,815.00	¥ 10,685.00

	China Low Volatility Equity Portfolio		
	31. August 2022 [^]	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen.....	\$ 121,824,745	\$ 153,597,072	\$ 146,211,198
Klasse			
A	\$ 47.68	\$ 64.41	\$ 67.15
A EUR	€ 47.44	€ 54.54	€ 56.28
A HKD	HKD374.26	HKD501.00	N/A
A PLN H	PLN80.57	PLN107.36	PLN113.07
AD	\$ 13.51	\$ 19.09	\$ 20.58
AD AUD H	AUD12.03	AUD17.23	AUD18.76
AD CAD H	CAD12.47	CAD17.80	CAD19.30
AD EUR H	€ 12.87	€ 18.37	€ 19.91
AD GBP H	£ 12.65	£ 18.08	£ 19.61
AD HKD	HKD106.05	HKD148.48	N/A
AD NZD H	NZD12.39	NZD17.67	NZD19.21
AD RMB H (20)	N/A	CNH122.63	CNH132.49
AD SGD H	SGD12.77	SGD18.12	SGD19.59
AD ZAR H	R80.64	R116.49	R125.78
B	\$ 37.19	\$ 50.74	\$ 53.42
B EUR	€ 37.00	€ 42.97	€ 44.77
BD	N/A	N/A	\$ 20.62
BD AUD H	N/A	N/A	AUD18.74
BD EUR H	N/A	N/A	€ 19.87
BD NZD H	NZD12.46	NZD17.76	NZD19.30
BD ZAR H (21)	N/A	R117.43	R126.91
C	\$ 44.46	\$ 60.34	\$ 63.19
C EUR	€ 44.24	€ 51.10	€ 52.96
I	\$ 57.96	\$ 77.67	\$ 80.33
I EUR	€ 57.67	€ 65.78	€ 67.33
S	\$ 73.44	\$ 97.41	\$ 99.71
S1	\$ 65.05	\$ 86.93	\$ 89.66
S1 EUR	€ 64.74	€ 73.63	€ 75.15

	Short Duration Bond Portfolio		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen	\$ 479,574,798	\$ 531,284,341	\$ 570,960,697
Klasse			
A	\$ 7.13	\$ 7.59	\$ 7.76
A EUR	€ 7.11	€ 6.43	€ 6.50
A2	\$ 17.74	\$ 18.45	\$ 18.44
A2 EUR	€ 17.66	€ 15.63	€ 15.46
A2 EUR H	€ 13.73	€ 14.48	€ 14.60
A2 HKD	HKD139.28	HKD143.56	N/A
A2 SGD H (22)	N/A	SGD15.59	SGD15.58
AA	\$ 10.70	\$ 11.52	\$ 11.94
AA AUD H	AUD10.51	AUD11.34	AUD11.80
AA CAD H	CAD10.75	CAD11.58	CAD12.02
AA GBP H	£ 10.69	£ 11.53	£ 11.99
AA HKD	HKD84.03	HKD89.65	N/A
AA NZD H (23)	N/A	NZD11.67	NZD12.11
AA SGD H	SGD10.71	SGD11.53	SGD11.96
AJ	\$ 6.86	\$ 7.30	\$ 7.45
AR EUR H (24)	N/A	€ 11.95	€ 12.39
AT	\$ 7.12	\$ 7.58	\$ 7.76
AT AUD H	AUD11.07	AUD11.81	AUD12.13
AT CAD H	CAD11.26	CAD11.98	CAD12.27
AT EUR	€ 7.11	€ 6.42	€ 6.50
AT EUR H	€ 10.89	€ 11.60	€ 11.88
AT GBP H	£ 11.32	£ 12.07	£ 12.38
AT HKD	HKD55.98	HKD58.97	N/A
AT NZD H	NZD11.44	NZD12.18	NZD12.47
AT SGD H	SGD11.62	SGD12.36	SGD12.65
AX	\$ 5.70	\$ 6.06	\$ 6.21
B	\$ 7.14	\$ 7.59	\$ 7.76
B2	N/A	N/A	\$ 14.52
B2 EUR (25)	N/A	€ 12.18	€ 12.17
BA	N/A	N/A	\$ 11.15
BT (26)	N/A	\$ 7.63	\$ 7.81
BT AUD H	N/A	N/A	AUD12.16
BT CAD H	N/A	N/A	CAD12.22
BT GBP H	N/A	N/A	£ 12.39
BX	N/A	N/A	\$ 6.20
C	\$ 7.14	\$ 7.59	\$ 7.76
C2	\$ 14.56	\$ 15.21	\$ 15.26
C2 EUR H	€ 12.98	€ 13.74	€ 13.91
I	\$ 7.14	\$ 7.59	\$ 7.77
I EUR	€ 7.12	€ 6.43	€ 6.51
I2	\$ 12.90	\$ 13.33	\$ 13.25
I2 AUD H (27)	N/A	AUD20.07	AUD20.00
I2 EUR	€ 12.83	€ 11.29	€ 11.11
I2 EUR H	€ 14.70	€ 15.41	€ 15.44
IT	\$ 11.72	\$ 12.46	\$ 12.75
IT AUD H (28)	N/A	AUD12.35	AUD12.67
N2	\$ 14.09	\$ 14.73	\$ 14.79
NT	\$ 11.56	\$ 12.29	\$ 12.57

Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)

	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
S	\$ 92.67	\$ 98.58	\$ 100.90
S EUR H (29)	N/A	€ 16.52	€ 16.48
S SGD H (30)	N/A	SGD17.99	SGD17.79
S1 2	\$ 16.36	\$ 16.88	\$ 16.74
S1 2 EUR	€ 16.28	€ 14.29	N/A
S1 EUR H (31)	N/A	€ 15.66	€ 15.66
SA	\$ 80.36	\$ 85.58	\$ 87.69

Global High Yield Portfolio

	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen	\$ 14,421,357,362	\$20,805,945,914	\$ 20,280,358,505
Klasse			
A	\$ 3.09	\$ 3.82	\$ 3.69
A EUR	€ 3.08	€ 3.23	€ 3.09
A2	\$ 15.12	\$ 17.48	\$ 15.81
A2 CHF H	CHF14.11	CHF16.63	CHF15.24
A2 EUR	€ 15.04	€ 14.80	€ 13.25
A2 EUR H	€ 21.32	€ 25.09	€ 22.92
A2 HKD	HKD118.67	HKD135.99	N/A
A2 PLN H	PLN95.78	PLN108.67	PLN98.88
A2 SGD	SGD21.14	SGD23.52	N/A
A2 SGD H	SGD19.62	SGD22.75	SGD20.60
AA	\$ 8.28	\$ 10.47	\$ 10.31
AA AUD H	AUD7.76	AUD9.91	AUD9.80
AA CAD H	CAD7.87	CAD9.99	CAD9.87
AA EUR H	€ 8.00	€ 10.17	€ 10.03
AA GBP H	£ 7.83	£ 9.99	£ 9.87
AA HKD	HKD65.01	HKD81.46	N/A
AA NZD H	NZD7.85	NZD10.01	NZD9.88
AA RMB H	CNH54.32	CNH68.85	CNH67.73
AA SGD H	SGD8.09	SGD10.26	SGD10.11
AA ZAR H	R53.40	R67.97	R66.68
AK	\$ 10.01	\$ 12.43	\$ 12.05
AK EUR	€ 10.01	€ 10.54	€ 10.10
AK EUR H	€ 9.84	€ 12.24	€ 11.89
AR EUR H	€ 8.50	€ 10.73	€ 10.60
AT	\$ 3.05	\$ 3.78	\$ 3.66
AT AUD H	AUD10.20	AUD12.74	AUD12.39
AT CAD H	CAD9.35	CAD11.63	CAD11.28
AT EUR	€ 3.05	€ 3.20	€ 3.07
AT EUR H	€ 10.41	€ 12.95	€ 12.55
AT GBP H	£ 10.31	£ 12.87	£ 12.50
AT HKD	HKD23.99	HKD29.42	N/A
AT NZD H	NZD9.42	NZD11.75	NZD11.40
AT RMB H	CNH67.98	CNH84.34	CNH81.49
AT SGD	SGD4.28	SGD5.09	N/A
AT SGD H	SGD9.52	SGD11.82	SGD11.44
B	\$ 3.09	\$ 3.82	\$ 3.69
B2	\$ 21.42	\$ 25.02	\$ 22.85
B2 EUR H	N/A	N/A	€ 20.59

	Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
BA (32)	\$ 7.54	\$ 9.64	\$ 9.58
BA AUD H	AUD7.05	AUD9.11	AUD9.11
BA ZAR H (33)	N/A	R62.10	R61.54
BT	\$ 3.12	\$ 3.86	\$ 3.73
BT AUD H	AUD10.22	AUD12.75	AUD12.40
BT CAD H (34)	N/A	CAD11.64	CAD11.28
BT EUR H (35)	N/A	€ 12.98	€ 12.59
BT GBP H (36)	N/A	£ 12.89	£ 12.52
BT HKD	HKD24.48	HKD30.00	N/A
BT NZD H	NZD9.56	NZD11.88	NZD11.52
C	\$ 3.09	\$ 3.82	\$ 3.69
C EUR	€ 3.08	€ 3.23	€ 3.10
C2	\$ 21.15	\$ 24.59	\$ 22.35
C2 EUR	€ 21.05	€ 20.82	€ 18.73
C2 EUR H	€ 16.75	€ 19.81	€ 18.19
CK	\$ 9.99	\$ 12.40	\$ 12.02
CK EUR H	€ 9.85	€ 12.24	€ 11.87
CT	\$ 10.39	\$ 12.86	\$ 12.44
EA	\$ 9.95	\$ 12.66	\$ 12.53
EA AUD H	AUD10.26	AUD13.18	AUD13.11
EA ZAR H	R69.54	R89.01	R87.81
I	\$ 3.09	\$ 3.82	\$ 3.69
I EUR	€ 3.08	€ 3.23	€ 3.09
I2	\$ 9.71	\$ 11.17	\$ 10.05
I2 AUD H	AUD25.89	AUD30.10	AUD27.21
I2 CHF H	CHF14.66	CHF17.20	CHF15.68
I2 EUR	€ 9.66	€ 9.46	€ 8.43
I2 EUR H	€ 22.72	€ 26.61	€ 24.19
I2 SGD	SGD13.58	SGD15.03	N/A
I2 SGD H	SGD17.06	SGD19.69	SGD17.74
IA AUD H	AUD9.90	AUD12.60	AUD12.41
IQD	\$ 9.80	\$ 12.16	\$ 11.78
IQD EUR	€ 9.82	€ 10.30	€ 9.87
IT	\$ 9.59	\$ 11.88	\$ 11.49
IT AUD H	AUD9.05	AUD11.32	AUD11.00
IT CAD H	CAD11.14	CAD13.85	CAD13.44
IT EUR H	€ 10.32	€ 12.85	€ 12.46
IT GBP H	£ 11.07	£ 13.81	£ 13.42
IT HKD	HKD75.28	HKD92.38	N/A
IT NZD H (37)	N/A	NZD13.73	NZD13.33
IT RMB H	CNH64.89	CNH80.53	CNH77.82
J	\$ 3.32	\$ 4.11	\$ 3.97
N2	\$ 17.42	\$ 20.26	\$ 18.43
NT	\$ 9.84	\$ 12.17	\$ 11.77
S EUR H	N/A	N/A	€ 106.45
S1	\$ 26.14	\$ 30.03	\$ 26.99
S1 EUR	€ 26.02	€ 25.43	€ 22.62
S1D	\$ 14.96	\$ 17.98	\$ 16.85
SA	\$ 64.44	\$ 80.17	\$ 77.65
SHK	\$ 71.27	\$ 88.60	\$ 85.84

	Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
SK	\$ 35.21	\$ 40.34	\$ 36.16
SQ	N/A	N/A	\$ 95.19
W	\$ 11.63	\$ 14.39	\$ 13.96
W EUR	€ 11.61	€ 12.19	€ 11.70
W2	\$ 15.03	\$ 17.27	\$ 15.52
W2 CHF H	CHF13.38	CHF15.66	CHF14.27
W2 EUR H	€ 13.68	€ 16.02	€ 14.53
WT	\$ 10.57	\$ 13.10	\$ 12.69
WT AUD H	AUD10.06	AUD12.59	AUD12.26
WT CAD H	CAD11.31	CAD14.06	CAD13.66
WT EUR H	€ 10.36	€ 12.90	€ 12.53
WT GBP H	£ 11.21	£ 13.99	£ 13.61
WT RMB H	CNH76.63	CNH95.08	CNH92.01
	American Income Portfolio		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen	\$ 16,566,716,085	\$ 24,837,439,539	\$ 28,197,385,467
Klasse			
A	\$ 6.69	\$ 8.12	\$ 8.17
A EUR	€ 6.68	€ 6.88	€ 6.85
A2	\$ 28.52	\$ 32.84	\$ 31.47
A2 CHF H	CHF14.64	CHF17.19	CHF16.67
A2 DUR PH	\$ 17.99	\$ 18.86	\$ 17.89
A2 EUR	€ 28.37	€ 27.81	€ 26.37
A2 EUR H	€ 17.47	€ 20.47	€ 19.80
A2 HKD	HKD223.83	HKD255.44	N/A
A2 PLN H	PLN97.57	PLN109.95	PLN105.80
A2 SGD	SGD39.88	SGD44.19	N/A
A2 SGD H	SGD19.33	SGD22.30	SGD21.39
AA	\$ 10.14	\$ 12.51	\$ 12.75
AA AUD H	AUD9.73	AUD12.08	AUD12.36
AA CAD H	CAD9.68	CAD11.97	CAD12.23
AA DUR PH	\$ 10.34	\$ 11.59	\$ 11.69
AA EUR H	€ 9.70	€ 12.02	€ 12.27
AA GBP H	£ 9.58	£ 11.89	£ 12.16
AA HKD	HKD79.60	HKD97.28	N/A
AA NZD H	NZD9.67	NZD11.99	NZD12.25
AA RMB H	CNH66.07	CNH81.62	CNH83.13
AA SGD H	SGD9.89	SGD12.23	SGD12.47
AA ZAR H	R66.91	R82.71	R83.92
AK	\$ 11.10	\$ 13.53	\$ 13.62
AK EUR	€ 11.13	€ 11.46	€ 11.42
AK EUR H	€ 10.96	€ 13.36	€ 13.46
AR EUR	€ 11.38	€ 12.00	€ 12.13
AR EUR H	€ 9.95	€ 12.21	€ 12.48
AT	\$ 6.68	\$ 8.12	\$ 8.16
AT AUD H	AUD11.04	AUD13.51	AUD13.64
AT CAD H	CAD11.01	CAD13.43	CAD13.53
AT DUR PH	\$ 11.74	\$ 12.95	\$ 12.89
AT EUR	€ 6.68	€ 6.87	€ 6.84

American Income Portfolio (Fortsetzung)

	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
AT EUR H	€ 11.02	€ 13.45	€ 13.54
AT GBP H	£ 10.91	£ 13.33	£ 13.46
AT HKD	HKD52.44	HKD63.13	N/A
AT NZD H	NZD10.52	NZD12.85	NZD12.96
AT RMB H	CNH74.80	CNH91.05	CNH91.47
AT SGD	SGD9.35	SGD10.92	N/A
AT SGD H	SGD11.10	SGD13.52	SGD13.62
B	\$ 6.69	\$ 8.12	\$ 8.17
B2	\$ 22.50	\$ 26.09	\$ 25.17
B2 HKD	HKD176.60	HKD202.95	N/A
BA	\$ 9.51	\$ 11.82	\$ 12.13
BA AUD H	AUD9.10	AUD11.38	AUD11.74
BA ZAR H (38)	N/A	R78.64	R80.27
BT	\$ 6.74	\$ 8.18	\$ 8.23
BT AUD H	AUD11.12	AUD13.59	AUD13.72
BT CAD H	CAD10.94	CAD13.31	CAD13.42
BT EUR (39)	N/A	€ 6.93	€ 6.90
BT EUR H (40)	€ 11.03	€ 13.45	€ 13.55
BT GBP H	£ 11.00	£ 13.43	£ 13.55
BT HKD	HKD52.91	HKD63.64	N/A
BT NZD H	NZD10.59	NZD12.92	NZD13.02
C	\$ 6.69	\$ 8.12	\$ 8.17
C EUR	€ 6.69	€ 6.88	€ 6.85
C2	\$ 34.52	\$ 39.93	\$ 38.44
C2 DUR PH	\$ 17.25	\$ 18.16	\$ 17.30
C2 EUR	€ 34.34	€ 33.82	€ 32.21
C2 EUR H	€ 16.58	€ 19.51	€ 18.95
CT	\$ 11.19	\$ 13.59	\$ 13.67
EA	\$ 11.59	\$ 14.38	\$ 14.73
EA AUD H	AUD11.23	AUD14.02	AUD14.43
EA ZAR H	R76.85	R95.55	R97.34
I	\$ 6.69	\$ 8.12	\$ 8.17
I EUR	€ 6.68	€ 6.88	€ 6.85
I2	\$ 17.12	\$ 19.61	\$ 18.68
I2 AUD H	AUD14.97	AUD17.29	AUD16.54
I2 CHF H	CHF15.44	CHF18.03	CHF17.40
I2 DUR PH	\$ 18.70	\$ 19.49	\$ 18.39
I2 EUR	€ 17.03	€ 16.60	€ 15.66
I2 EUR H	€ 19.03	€ 22.17	€ 21.32
I2 HKD	HKD134.36	HKD152.50	N/A
I2 SGD	SGD23.95	SGD26.38	N/A
I2 SGD H	SGD17.39	SGD19.96	SGD19.04
IA	\$ 11.66	\$ 14.30	\$ 14.50
IA AUD H	AUD11.25	AUD13.89	AUD14.13
IT	\$ 10.90	\$ 13.25	\$ 13.33
IT AUD H	AUD10.32	AUD12.64	AUD12.76
IT CAD H	CAD12.01	CAD14.64	CAD14.77
IT EUR H	€ 12.00	€ 14.65	€ 14.75
IT GBP H	£ 11.91	£ 14.57	£ 14.70
IT HKD	HKD85.57	HKD103.07	N/A

American Income Portfolio (Fortsetzung)

	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
IT JPY	<u>¥10.425.00</u>	<u>¥ 9.954.00</u>	<u>¥ 9.632.00</u>
IT JPY H	<u>¥ 7.002.00</u>	<u>¥ 8.565.00</u>	<u>¥ 8.619.00</u>
IT NZD H	<u>NZD11.94</u>	<u>NZD14.60</u>	<u>NZD14.72</u>
IT RMB H	<u>CNH81.38</u>	<u>CNH99.14</u>	<u>CNH99.66</u>
IT SGD	<u>SGD15.26</u>	<u>SGD17.83</u>	<u>N/A</u>
IT SGD H	<u>SGD11.23</u>	<u>SGD13.68</u>	<u>SGD13.77</u>
J	<u>\$ 6.82</u>	<u>\$ 8.28</u>	<u>\$ 8.33</u>
L2	<u>\$ 14.12</u>	<u>\$ 16.22</u>	<u>\$ 15.50</u>
L2 AUD H (41)	<u>N/A</u>	<u>AUD15.78</u>	<u>AUD15.13</u>
L2 SGD H (42)	<u>N/A</u>	<u>SGD16.06</u>	<u>SGD15.36</u>
LT	<u>\$ 12.06</u>	<u>\$ 14.66</u>	<u>\$ 14.75</u>
LT AUD H (43)	<u>N/A</u>	<u>AUD14.43</u>	<u>AUD14.57</u>
LT SGD H (44)	<u>N/A</u>	<u>SGD14.69</u>	<u>SGD14.79</u>
N2	<u>\$ 16.73</u>	<u>\$ 19.38</u>	<u>\$ 18.67</u>
NT	<u>\$ 10.88</u>	<u>\$ 13.21</u>	<u>\$ 13.29</u>
S	<u>\$ 19.92</u>	<u>\$ 22.65</u>	<u>\$ 21.43</u>
S1	<u>\$ 22.16</u>	<u>\$ 25.33</u>	<u>\$ 24.08</u>
S1 EUR	<u>€ 22.05</u>	<u>€ 21.45</u>	<u>€ 20.18</u>
S1D	<u>\$ 13.66</u>	<u>\$ 16.32</u>	<u>\$ 16.16</u>
S1D2	<u>\$ 79.07</u>	<u>\$ 96.17</u>	<u>\$ 96.73</u>
SA	<u>\$ 75.39</u>	<u>\$ 91.74</u>	<u>\$ 92.31</u>
SHK	<u>\$ 78.38</u>	<u>\$ 95.32</u>	<u>\$ 95.92</u>
W	<u>\$ 12.03</u>	<u>\$ 14.62</u>	<u>\$ 14.71</u>
W2	<u>\$ 15.80</u>	<u>\$ 18.07</u>	<u>\$ 17.19</u>
W2 CHF H	<u>CHF14.06</u>	<u>CHF16.39</u>	<u>CHF15.79</u>
W2 EUR H	<u>€ 14.29</u>	<u>€ 16.61</u>	<u>€ 15.96</u>
WT	<u>\$ 12.04</u>	<u>\$ 14.64</u>	<u>\$ 14.72</u>
WT AUD H	<u>AUD11.62</u>	<u>AUD14.23</u>	<u>AUD14.37</u>
WT EUR H	<u>€ 12.06</u>	<u>€ 14.73</u>	<u>€ 14.83</u>
WT GBP H	<u>£ 11.88</u>	<u>£ 14.54</u>	<u>£ 14.67</u>
WT HKD	<u>HKD94.52</u>	<u>HKD113.86</u>	<u>N/A</u>
WT SGD H	<u>SGD11.92</u>	<u>SGD14.53</u>	<u>SGD14.63</u>

European Income Portfolio

	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen	<u>€ 1,411,076,501</u>	<u>€ 2,245,496,354</u>	<u>€ 2,426,429,717</u>
Klasse			
A	<u>€ 5.76</u>	<u>€ 6.87</u>	<u>€ 6.78</u>
A USD	<u>\$ 5.77</u>	<u>\$ 8.11</u>	<u>\$ 8.09</u>
A2	<u>€ 19.23</u>	<u>€ 22.14</u>	<u>€ 21.14</u>
A2 CHF H	<u>CHF14.70</u>	<u>CHF16.97</u>	<u>CHF16.26</u>
A2 PLN H	<u>PLN100.08</u>	<u>PLN110.81</u>	<u>PLN105.30</u>
A2 SGD H (45)	<u>N/A</u>	<u>SGD19.17</u>	<u>SGD18.16</u>
A2 USD	<u>\$ 19.33</u>	<u>\$ 26.14</u>	<u>\$ 25.22</u>
A2 USD H	<u>\$ 17.53</u>	<u>\$ 19.86</u>	<u>\$ 18.81</u>
AA	<u>€ 10.44</u>	<u>€ 12.63</u>	<u>€ 12.65</u>
AA AUD H	<u>AUD10.21</u>	<u>AUD12.39</u>	<u>AUD12.42</u>
AA HKD H	<u>HKD69.43</u>	<u>HKD83.93</u>	<u>HKD84.16</u>
AA RMB H	<u>CNH69.66</u>	<u>CNH84.11</u>	<u>CNH84.01</u>
AA SGD H	<u>SGD10.37</u>	<u>SGD12.52</u>	<u>SGD12.51</u>

	European Income Portfolio (Fortsetzung)		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
AA USD H	\$ 10.57	\$ 12.75	\$ 12.75
AK	€ 12.12	€ 14.49	€ 14.30
AR	€ 10.29	€ 12.48	€ 12.52
AT	€ 5.76	€ 6.88	€ 6.78
ATAUD H	AUD12.29	AUD14.70	AUD14.53
ATSGD H	SGD11.75	SGD13.98	SGD13.76
ATUSD	\$ 5.77	\$ 8.12	\$ 8.09
ATUSD H	\$ 12.67	\$ 15.06	\$ 14.84
B	N/A	N/A	€ 6.78
BUSD	\$ 5.78	\$ 8.11	\$ 8.09
B2	€ 16.37	€ 18.98	€ 18.25
B2USD	\$ 16.45	\$ 22.41	\$ 21.77
BA (46)	N/A	€ 11.95	€ 12.05
BAAUD H	AUD9.59	AUD11.72	AUD11.84
BAUSD H	\$ 9.94	\$ 12.06	\$ 12.16
BT	€ 5.77	€ 6.88	€ 6.78
BTAUD H	AUD12.34	AUD14.74	AUD14.57
BTUSD (47)	N/A	\$ 8.12	\$ 8.09
BTUSD H	\$ 12.67	\$ 15.06	\$ 14.84
C	€ 5.77	€ 6.87	€ 6.78
CUSD	\$ 5.78	\$ 8.11	\$ 8.09
C2	€ 18.11	€ 20.94	€ 20.09
C2USD	\$ 18.20	\$ 24.73	\$ 23.97
C2USD H	\$ 16.65	\$ 18.95	\$ 18.02
CK	€ 12.12	€ 14.47	€ 14.28
CTUSD H	\$ 11.67	\$ 13.88	\$ 13.68
I	€ 5.76	€ 6.87	€ 6.78
IUSD	\$ 5.77	\$ 8.11	\$ 8.09
I2	€ 12.96	€ 14.84	€ 14.09
I2AUD H	AUD28.05	AUD31.88	AUD30.13
I2CHF H	CHF15.06	CHF17.29	CHF16.73
I2USD	\$ 13.03	\$ 17.52	\$ 16.81
I2USD H	\$ 25.09	\$ 28.28	\$ 26.62
IA	€ 11.52	€ 13.86	€ 13.79
IAHKD H	HKD77.21	HKD92.75	HKD92.47
IASGD H	SGD11.52	SGD13.82	SGD13.72
IAUSD H	\$ 11.72	\$ 14.05	\$ 13.97
IT	€ 12.19	€ 14.54	€ 14.34
ITSGD H	SGD12.21	SGD14.53	SGD14.29
ITUSD H	\$ 12.02	\$ 14.29	\$ 14.07
NTUSD H	\$ 12.27	\$ 14.59	\$ 14.38
S	N/A	N/A	€ 114.26
S1	€ 21.27	€ 24.30	€ 23.03
S1USD	\$ 21.38	\$ 28.69	\$ 27.48
S1USD H	\$ 23.56	\$ 26.49	\$ 24.89
S1D	€ 12.05	€ 14.39	€ 14.20
SAUSD H	\$ 79.48	\$ 94.84	\$ 93.62
SHK	€ 79.48	€ 94.85	€ 93.55
W2	€ 13.98	€ 15.98	€ 15.16

	European Income Portfolio (Fortsetzung)		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
W2 CHF H	<u>CHF14.51</u>	<u>CHF16.63</u>	<u>CHF15.82</u>
W2 USD H	<u>\$ 14.63</u>	<u>\$ 16.46</u>	<u>\$ 15.47</u>
WA	<u>€ 12.18</u>	<u>€ 14.63</u>	<u>€ 14.53</u>
WA HKD H	<u>HKD81.55</u>	<u>HKD97.78</u>	<u>HKD97.28</u>
WA USD H	<u>\$ 12.29</u>	<u>\$ 14.71</u>	<u>\$ 14.60</u>
WT	<u>€ 12.42</u>	<u>€ 14.82</u>	<u>€ 14.62</u>
WT SGD H	<u>SGD12.47</u>	<u>SGD14.84</u>	<u>SGD14.60</u>
WT USD H	<u>\$ 12.53</u>	<u>\$ 14.91</u>	<u>\$ 14.68</u>
	Emerging Markets Debt Portfolio		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen.....	<u>\$ 502,511,882</u>	<u>\$ 870,118,646</u>	<u>\$ 941,712,812</u>
Klasse			
A	<u>\$ 10.53</u>	<u>\$ 14.52</u>	<u>\$ 14.41</u>
A EUR	<u>€ 10.53</u>	<u>€ 12.30</u>	<u>€ 12.08</u>
A2	<u>\$ 27.73</u>	<u>\$ 36.18</u>	<u>\$ 34.23</u>
A2 CHF H	<u>CHF12.38</u>	<u>CHF16.46</u>	<u>CHF15.78</u>
A2 EUR	<u>€ 27.59</u>	<u>€ 30.64</u>	<u>€ 28.69</u>
A2 EUR H	<u>€ 16.78</u>	<u>€ 22.31</u>	<u>€ 21.34</u>
A2 HKD	<u>HKD217.64</u>	<u>HKD281.39</u>	<u>N/A</u>
A2 PLN	<u>PLN130.32</u>	<u>PLN138.56</u>	<u>N/A</u>
A2 PLN H	<u>PLN85.54</u>	<u>PLN110.09</u>	<u>PLN105.14</u>
A2 SGD H	<u>SGD17.30</u>	<u>SGD22.64</u>	<u>SGD21.46</u>
AA	<u>\$ 8.70</u>	<u>\$ 12.19</u>	<u>\$ 12.27</u>
AA AUD H	<u>AUD8.14</u>	<u>AUD11.50</u>	<u>AUD11.65</u>
AA CAD H	<u>CAD8.01</u>	<u>CAD11.27</u>	<u>CAD11.39</u>
AA EUR H	<u>€ 8.12</u>	<u>€ 11.45</u>	<u>€ 11.56</u>
AA GBP H	<u>£ 7.97</u>	<u>£ 11.25</u>	<u>£ 11.39</u>
AA HKD	<u>HKD68.29</u>	<u>HKD94.81</u>	<u>N/A</u>
AA NZD H	<u>NZD7.93</u>	<u>NZD11.20</u>	<u>NZD11.31</u>
AA RMB H	<u>CNH61.00</u>	<u>CNH85.67</u>	<u>CNH86.21</u>
AA SGD H	<u>SGD8.45</u>	<u>SGD11.88</u>	<u>SGD11.97</u>
AA ZAR H	<u>R55.89</u>	<u>R78.80</u>	<u>R79.14</u>
AI	<u>\$ 51.66</u>	<u>\$ 74.73</u>	<u>N/A</u>
AI AUD H	<u>AUD51.10</u>	<u>AUD74.55</u>	<u>N/A</u>
AR EUR	<u>€ 9.93</u>	<u>€ 11.88</u>	<u>€ 11.85</u>
AT	<u>\$ 10.57</u>	<u>\$ 14.58</u>	<u>\$ 14.47</u>
AT AUD H	<u>AUD9.25</u>	<u>AUD12.88</u>	<u>AUD12.87</u>
AT CAD H	<u>CAD8.51</u>	<u>CAD11.79</u>	<u>CAD11.74</u>
AT EUR	<u>€ 10.57</u>	<u>€ 12.35</u>	<u>€ 12.13</u>
AT EUR H	<u>€ 9.63</u>	<u>€ 13.38</u>	<u>€ 13.31</u>
AT GBP H	<u>£ 8.51</u>	<u>£ 11.83</u>	<u>£ 11.81</u>
AT HKD	<u>HKD82.98</u>	<u>HKD113.43</u>	<u>N/A</u>
AT NZD H	<u>NZD8.28</u>	<u>NZD11.52</u>	<u>NZD11.48</u>
AT RMB H (48)	<u>N/A</u>	<u>CNH88.59</u>	<u>CNH87.93</u>
AT SGD H	<u>SGD9.27</u>	<u>SGD12.83</u>	<u>SGD12.76</u>
B	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>\$ 14.41</u>
B2	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>\$ 29.62</u>
B2 EUR (49)	<u>N/A</u>	<u>€ 26.25</u>	<u>€ 24.83</u>

	Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
B2 HKD	<u>HKD184.66</u>	<u>HKD241.14</u>	<u>N/A</u>
BA (50)	<u>N/A</u>	<u>\$ 11.25</u>	<u>\$ 11.43</u>
BA AUD H (51)	<u>N/A</u>	<u>AUD10.63</u>	<u>AUD10.87</u>
BA ZAR H (52)	<u>N/A</u>	<u>R72.43</u>	<u>R73.48</u>
BT	<u>\$ 10.56</u>	<u>\$ 14.54</u>	<u>\$ 14.43</u>
BT AUD H (53)	<u>N/A</u>	<u>AUD12.90</u>	<u>AUD12.87</u>
BT CAD H	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>CAD11.74</u>
BT EUR H (54)	<u>N/A</u>	<u>€ 13.41</u>	<u>€ 13.33</u>
BT GBP H	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>£ 11.77</u>
BT HKD (55)	<u>N/A</u>	<u>HKD113.12</u>	<u>N/A</u>
BT NZD H	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>NZD11.55</u>
C	<u>\$ 10.54</u>	<u>\$ 14.53</u>	<u>\$ 14.41</u>
C EUR	<u>€ 10.53</u>	<u>€ 12.30</u>	<u>€ 12.08</u>
C2	<u>\$ 25.73</u>	<u>\$ 33.72</u>	<u>\$ 32.04</u>
C2 EUR	<u>€ 25.60</u>	<u>€ 28.55</u>	<u>€ 26.86</u>
C2 EUR H	<u>€ 15.94</u>	<u>€ 21.29</u>	<u>€ 20.45</u>
CT	<u>\$ 8.95</u>	<u>\$ 12.34</u>	<u>\$ 12.25</u>
EA	<u>\$ 10.19</u>	<u>\$ 14.35</u>	<u>\$ 14.52</u>
EA AUD H	<u>AUD9.77</u>	<u>AUD13.88</u>	<u>AUD14.14</u>
EA ZAR H	<u>R66.43</u>	<u>R94.15</u>	<u>R94.99</u>
EI	<u>\$ 51.24</u>	<u>\$ 74.50</u>	<u>N/A</u>
EI AUD H	<u>AUD50.69</u>	<u>AUD74.36</u>	<u>N/A</u>
I	<u>\$ 10.52</u>	<u>\$ 14.53</u>	<u>\$ 14.42</u>
I2	<u>\$ 30.33</u>	<u>\$ 39.36</u>	<u>\$ 37.03</u>
I2 AUD H (56)	<u>AUD13.94</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
I2 CHF H	<u>CHF13.06</u>	<u>CHF17.27</u>	<u>CHF16.47</u>
I2 EUR	<u>€ 30.18</u>	<u>€ 33.33</u>	<u>€ 31.03</u>
I2 EUR H	<u>€ 18.03</u>	<u>€ 23.84</u>	<u>€ 22.67</u>
IT	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>\$ 12.24</u>
IT AUD H	<u>AUD8.30</u>	<u>AUD11.57</u>	<u>AUD11.55</u>
IT EUR H	<u>€ 9.20</u>	<u>€ 12.79</u>	<u>€ 12.74</u>
IT SGD H (57)	<u>N/A</u>	<u>SGD12.01</u>	<u>SGD11.94</u>
N2	<u>\$ 14.24</u>	<u>\$ 18.68</u>	<u>\$ 17.77</u>
NT	<u>\$ 8.70</u>	<u>\$ 11.99</u>	<u>\$ 11.89</u>
S	<u>\$ 30.13</u>	<u>\$ 38.83</u>	<u>\$ 36.28</u>
S EUR H (58)	<u>N/A</u>	<u>€ 24.53</u>	<u>€ 23.15</u>
S GBP H (59)	<u>N/A</u>	<u>£ 25.92</u>	<u>£ 24.34</u>
S1 2	<u>\$ 28.18</u>	<u>\$ 36.52</u>	<u>\$ 34.31</u>
S1 2 EUR	<u>€ 28.06</u>	<u>€ 30.93</u>	<u>€ 28.76</u>
S1 EUR H	<u>€ 17.45</u>	<u>€ 23.04</u>	<u>€ 21.86</u>
S1 GBP H	<u>£ 18.67</u>	<u>£ 24.36</u>	<u>£ 23.01</u>
S1QD EUR H (60)	<u>N/A</u>	<u>€ 98.69</u>	<u>€ 98.17</u>
SA	<u>\$ 64.72</u>	<u>\$ 89.53</u>	<u>\$ 88.93</u>

	Mortgage Income Portfolio		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
Nettovermögen.....	\$ 829,713,296	\$1,493,772,913	\$1,322,589,619
Klasse			
A	\$ 11.22	\$ 12.18	\$ 12.00
A2	\$ 17.83	\$ 18.33	\$ 17.03
A2 EUR	€ 17.74	€ 15.52	€ 14.27
A2 HKD	HKD139.98	HKD142.59	N/A
A2 SGD	SGD24.94	SGD24.67	N/A
A2X	\$ 12.78	\$ 13.13	\$ 12.19
A2X EUR	€ 12.71	€ 11.12	€ 10.22
AA	\$ 9.89	\$ 10.91	\$ 10.89
AA AUD H	AUD9.53	AUD10.55	AUD10.58
AA HKD	HKD77.67	HKD84.83	N/A
AA RMB H	CNH67.55	CNH74.47	CNH74.25
AA SGD H	SGD9.78	SGD10.79	SGD10.78
AA ZAR H	R66.17	R72.79	R72.23
AR EUR H	€ 9.70	€ 10.87	€ 10.88
AT	\$ 11.24	\$ 12.21	\$ 12.03
AT AUD H	AUD10.87	AUD11.86	AUD11.73
AT EUR	€ 11.23	€ 10.34	€ 10.08
AT GBP H	£ 11.72	£ 12.77	£ 12.62
AT HKD	HKD88.26	HKD94.97	N/A
AT SGD	SGD15.73	SGD16.43	N/A
AT SGD H	SGD11.09	SGD12.07	SGD11.89
AX	\$ 5.43	\$ 5.90	\$ 5.81
AX EUR	€ 5.43	€ 5.00	€ 4.87
B2X (61)	N/A	\$ 12.41	\$ 11.58
BA	N/A	N/A	\$ 10.14
BAAUD H	N/A	N/A	AUD9.85
BA ZAR H	N/A	N/A	R67.40
BX	\$ 5.43	\$ 5.90	\$ 5.81
BX EUR	€ 5.42	€ 5.00	€ 4.87
C	\$ 11.23	\$ 12.20	\$ 12.01
C2	\$ 17.13	\$ 17.69	\$ 16.51
C2 EUR	€ 17.05	€ 14.98	N/A
C2X (62)	N/A	\$ 17.53	\$ 16.35
CX	\$ 5.43	\$ 5.90	\$ 5.81
I	\$ 11.22	\$ 12.19	\$ 12.01
I EUR	€ 11.20	€ 10.32	€ 10.07
I2	\$ 18.68	\$ 19.10	\$ 17.65
I2 EUR	€ 18.59	€ 16.17	€ 14.79
I2 EUR H	€ 14.40	€ 14.93	€ 13.93
I2X (63)	N/A	\$ 11.75	\$ 10.85
IT EUR H	€ 11.83	€ 12.89	€ 12.71
IX	\$ 5.43	\$ 5.90	\$ 5.81
N2	\$ 14.91	\$ 15.42	\$ 14.40
NT	\$ 11.96	\$ 13.00	\$ 12.80
S	\$ 11.19	\$ 12.16	\$ 11.97
S1	\$ 17.40	\$ 17.76	\$ 16.38
S1 EUR	€ 17.32	€ 15.04	€ 13.73
S1 EUR H	€ 94.16	€ 97.54	€ 90.81

	Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)		
	31. August 2022	31. August 2021	31. August 2020
S1 JPY	<u>¥ 12.733.00</u>	<u>¥ 10.291.00</u>	<u>¥ 9.138.00</u>
S1X (64)	<u>N/A</u>	<u>\$ 5.90</u>	<u>\$ 5.81</u>
SA	<u>\$ 73.40</u>	<u>\$ 79.92</u>	<u>\$ 78.76</u>

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

^ Der NAV und der NAV je Aktie entsprechen dem veröffentlichten NAV und dem veröffentlichten NAV je Aktie einschließlich etwaiger Anpassungen am Periodenende.

- (1) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von €22.26
- (2) Aufgelöst am 4. Oktober 2021 mit einem abschließenden NAV von €22.45 und am 26. Oktober 2021 neu aufgelegt.
- (3) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von SGD15.20
- (4) Aufgelöst am 20. September 2021 mit einem abschließenden NAV von \$16.46
- (5) Auflegungsdatum 15. Februar 2022
- (6) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von AUD19.03
- (7) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von \$68.26
- (8) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von SGD15.53
- (9) Aufgelöst am 29. Juli 2022 mit einem abschließenden NAV von CAD10.57
- (10) Aufgelöst am 31. Mai 2022 mit einem abschließenden NAV von NZD14.88
- (11) Aufgelöst am 20. Dezember 2021 mit einem abschließenden NAV von R99.51
- (12) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von AUD24.66
- (13) Auflegungsdatum 24. Juni 2022
- (14) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von \$16.39
- (15) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von AUD14.36
- (16) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von AUD23.22
- (17) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von NZD25.50
- (18) Aufgelöst am 20. Dezember 2021 mit einem abschließenden NAV von AUD14.88
- (19) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von \$26.66
- (20) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von CNH95.86
- (21) Aufgelöst am 20. September 2021 mit einem abschließenden NAV von R113.15
- (22) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von SGD15.16
- (23) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von NZD11.18
- (24) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von €11.55
- (25) Aufgelöst am 24. Januar 2022 mit einem abschließenden NAV von €12.54
- (26) Aufgelöst am 21. Januar 2022 mit einem abschließenden NAV von \$7.50
- (27) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von AUD19.56
- (28) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von AUD11.87
- (29) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von €16.08
- (30) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von SGD17.60
- (31) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von €15.22
- (32) Aufgelöst am 31. August 2022 mit einem abschließenden NAV von \$7.54
- (33) Aufgelöst am 20. Dezember 2021 mit einem abschließenden NAV von R59.76
- (34) Aufgelöst am 30. Juni 2022 mit einem abschließenden NAV von CAD9.21
- (35) Aufgelöst am 30. November 2021 mit einem abschließenden NAV von €12.47
- (36) Aufgelöst am 30. Juni 2022 mit einem abschließenden NAV von £10.17
- (37) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von NZD12.37
- (38) Aufgelöst am 20. Dezember 2021 mit einem abschließenden NAV von R76.35
- (39) Aufgelöst am 20. September 2021 mit einem abschließenden NAV von €6.96
- (40) Aufgelöst am 31. August 2021 mit einem abschließenden NAV von €11.03
- (41) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von AUD14.53
- (42) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von SGD14.82
- (43) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von AUD12.94

- (44) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von SGD13.19
- (45) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von SGD18.16
- (46) Aufgelöst am 31. Januar 2022 mit einem abschließenden NAV von €11.39
- (47) Aufgelöst am 22. November 2021 mit einem abschließenden NAV von \$7.64
- (48) Aufgelöst am 15. Juli 2022 mit einem abschließenden NAV von CNH61.71
- (49) Aufgelöst am 20. Dezember 2021 mit einem abschließenden NAV von €26.18
- (50) Aufgelöst am 20. September 2021 mit einem abschließenden NAV von \$11.16
- (51) Aufgelöst am 20. September 2021 mit einem abschließenden NAV von AUD10.54
- (52) Aufgelöst am 20. Dezember 2021 mit einem abschließenden NAV von R68.15
- (53) Aufgelöst am 30. Dezember 2021 mit einem abschließenden NAV von AUD12.15
- (54) Aufgelöst am 30. Juni 2022 mit einem abschließenden NAV von €9.70
- (55) Aufgelöst am 29. Juli 2022 mit einem abschließenden NAV von HKD84.35
- (56) Auflegungsdatum 2. Juni 2022
- (57) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von SGD9.97
- (58) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von €20.89
- (59) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von £22.23
- (60) Aufgelöst am 11. Oktober 2021 mit einem abschließenden NAV von €95.39
- (61) Aufgelöst am 24. Januar 2022 mit einem abschließenden NAV von \$12.42
- (62) Aufgelöst am 20. Oktober 2021 mit einem abschließenden NAV von \$17.57
- (63) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von \$11.49
- (64) Aufgelöst am 25. März 2022 mit einem abschließenden NAV von \$5.58

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 AllianceBernstein (Luxemburg) S.à.r.l. (die „Verwaltungsgesellschaft“) verwaltet, einem Unternehmen, das gemäß den Gesetzen des Großherzogtums Luxemburg gegründet wurde und seinen eingetragenen Sitz in Luxemburg hat. Der Fonds erfüllt die Voraussetzungen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) im Sinne von Artikel 1 Absatz 2 der Richtlinie 2009/65/EG vom 13. Juli 2009 in ihrer jeweils gültigen Fassung.

Der Fonds besteht aus getrennten Anlagevermögen mit derzeit 14 aktiven Portefeuilles (einzeln das „Portefeuille“ und zusammengenommen 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 FCP I – 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 31. August 2022 angebotenen Anteilklassen:

AB FCP I–	Geschäftsaufnahme	Angebote Anteilklassen
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
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 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 EUR, ED, I, I AUD H, I EUR, N, S1, S1 EUR & S1 GBP
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	27. November 2009	A, A AUD H, A EUR, A HKD, A SGD H, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR, AD EUR H, AD GBP H, AD HKD, AD NZD H, AD RMB H, AD ZAR H, AY JPY, BD, BD AUD H, BD HKD, BY JPY, C, C EUR, ED, ED AUD H, I, I AUD H, I EUR, I GBP, S, S HKD, S1, S1 EUR & SD
Japan Strategic Value Portfolio	14. Dezember 2005	A, A CZK H, A EUR, A EUR H, A 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 & 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 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, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA GBP H, AA HKD, AA SGD H, AJ, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR, AT EUR H, AT GBP H, AT HKD, AT NZD H, AT SGD H, AX, B, C, C2, C2 EUR H, I, I EUR, I2, I2 EUR, I2 EUR H, IT, N2, NT, S, S1 2, S1 2 EUR & 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 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 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,

AB FCPI-	Geschäftsaufnahme	Angeborene Anteilklassen
American Income Portfolio (Fortsetzung)	30. Juni 1993	IT, IT AUD H, IT CAD H, IT EUR H, IT GBP H, IT HKD, IT JPY, IT JPY H, IT NZD H, IT RMB H, IT SGD, IT SGD H, J, L2, LT, 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 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 SGD H, B2 HKD, BT, C, C EUR, C2, C2 EUR, C2 EUR H, CT, EA, EA AUD H, EA ZAR H, EI, EI AUD H, I, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 EUR, I2 EUR H, IT AUD H, IT EUR H, N2, NT, S, S1 2, S1 2 EUR, S1 EUR H, S1 GBP H & 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, IT EUR H, IX, N2, NT, S, S1, S1 EUR, S1 EUR H, S1 JPY & SA

ANMERKUNG B: Relevante Bilanzierungsgrundsätze

Der Jahresabschluss wurde im Einklang mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und behördlichen Vorschriften und nach dem Fortführungsprinzip erstellt.

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 Wert-

papier 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 Kurstdienst 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 verwendet werden, muss der Bewertungsausschuss (der „Ausschuss“) vernünftigerweise zu dem Schluss kommen, dass die Verwendung der fortgeführten Anschaffungskosten in etwa dem beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers entspricht. Faktoren, die der Ausschuss dabei berücksichtigt, sind insbesondere eine Minderung der Kreditwürdigkeit des Emittenten 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 Kurstdienste, 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 Geschäftsjahres geltenden Wechselkursen dargestellt wird.

Dem Jahresabschluss wurden folgende Kurse zugrunde gelegt: Kassakurs von 1.0050 und Mittelkurs von 1.0970 für die Umrechnung von EUR in USD, Kassakurs von 0.0072 und Mittelkurs von 0.0082 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 Jahresabschlusses 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 Angaben offengelegte NAV je Anteil und das Gesamtvermögen sind der veröffentlichte NAV je Anteil und das Gesamtvermögen, wohingegen das in der Zusammensetzung des Fondsvermögens sowie in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens ausgewiesene Gesamtvermögen der Gesamt-NAV ohne Swing-Anpassungen zum Ende eines Berichtszeitraums ist.

Alle Swing Pricing unterliegenden Portefeuilles passten ihren NAV während des Berichtsjahres an. Zum 31. August 2022 passte das folgende Portefeuille seinen NAV an:

- China Low Volatility Equity Portfolio.

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

Für das Global Value Portfolio:

- Für Anteile der Klassen 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 Klassen AD und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den 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 Emerging Markets Growth Portfolio:

- Für Anteile der Klassen 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 Klassen AD und ED (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttun-

gen 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 Klassen A, AN, B, C, E, I, IN, S, S1, S1A GB, 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 widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen INN und SINN beabsichtigte die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios 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, 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 dargestellt und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduziert haben.

Für das Asia Ex-Japan Equity Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, C, I, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AY und BY kann die Verwaltungsgesellschaft im eigenen Ermessen auf Grundlage der Nettoerträge, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind, Dividenden erklären und ausschütten.
- Für Anteile der Klassen AD, BD, ED, ID und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den 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 abzüg-

lich 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 Klassen A, C, I, S, S1 und 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den 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 Klassen A, B, C, I, S und S1 beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen 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 Klassen A, AX, B, C, I, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H, sofern nicht anders angegeben) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AJ, AT, 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 Klassen AA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
- Für Anteile der Klassen A2, 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, 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 widergespiegelt.

Für das Global High Yield Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, JA, J und W (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, NT, S1D, S1D2 und WT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen IQD und S1QD beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind. Für Anteile der Klasse SK kann die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem Ermessen Dividenden erklären und ausschütten.
- Für Anteile der Klassen AK und 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 Klassen AA, BA, EA, IA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären

ren und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilsklassen 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 Klassen 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 widergespiegelt.

Für das American Income Portfolio:

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

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 Klassen 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 widergespiegelt.

Für das European Income Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C und I beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen 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 Klassen 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 Klassen 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 jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, 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 Klassen A, C und I (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, NT und ZT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, EA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
- Für Anteile der Klassen AI und EI (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und möglicherweise in erheblichem Umfang aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren. Falls der Nettoinventarwert je Anteil unter 1 USD bzw. 1 AUD fällt, wird die Verwaltungsgesellschaft in ihrem alleinigen Ermessen erwägen, entweder (i) die Anteilklasse umzustrukturieren, auch durch die Zusammenlegung mit einer Anteilklasse mit ähnlichen Merkmalen, oder (ii) die Anteilklasse zu liquidieren. Dividenden können auf Wunsch der Anteilinhaber automatisch wiederangelegt werden.

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

Für das Mortgage Income Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, AX, BX, C, CX, I, IX, S und S1X beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, ATX, IT, NT und ZT beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, EA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen I um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
- Für Anteile der Klassen 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(a)	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%	
Global Value Portfolio	Klasse S	0.12%
	Klasse S GBP	0.12%
	Klasse S GBP H	0.12%
	Klasse S1	0.82%
	Klasse S1 EUR	0.82%
	Klasse S1 GBP	0.82%
	Klasse SD	0.12%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Emerging Markets Growth Portfolio	Klasse S(a)	0.30%
	Klasse S1	1.20%
	Klasse S1 EUR	1.20%
	Klasse S1 GBP	1.20%
Sustainable US Thematic Portfolio(b)	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 GBP H	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%
	Klasse AD EUR H	2.05%
	Klasse AD GBP H	2.05%
	Klasse AD HKD	2.05%
	Klasse AD NZD H	2.05%
	Klasse AD RMB H	2.05%
	Klasse AD SGD H(a)	2.05%
Klasse AD ZAR H	2.05%	
Klasse AY JPY	2.05%	
Klasse BD	3.05%	
Klasse BD AUD H	3.05%	
Klasse BD CAD H(c)	3.05%	
Klasse BD HKD	3.05%	
Klasse BD NZD H(d)	3.05%	
Klasse BD ZAR H(e)	3.05%	

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Asia Ex-Japan Equity		
Portfolio (Fortsetzung)	Klasse BY JPY	2.52%
	Klasse C	2.50%
	Klasse C AUD H(a)	2.50%
	Klasse C EUR	2.50%
	Klasse ED	3.05%
	Klasse ED AUD H	3.05%
	Klasse I	1.25%
	Klasse I AUD H	1.25%
	Klasse I EUR	1.25%
	Klasse I GBP	1.25%
	Klasse ID(a)	1.25%
	Klasse ID AUD H(a)	1.25%
	Klasse S	0.30%
	Klasse S HKD	0.30%
	Klasse S1	1.20%
	Klasse S1 EUR	1.20%
	Klasse SD	0.30%
Japan Strategic Value		
Portfolio	Klasse A	1.70%(f)
	Klasse A AUD H(a)	1.70%(f)
	Klasse A CZK H	1.70%(f)
	Klasse A EUR	1.70%(f)
	Klasse A EUR H	1.70%(f)
	Klasse A NZD H(a)	1.70%(f)
	Klasse A PLN	1.70%(f)
	Klasse A SGD	1.70%(f)
	Klasse A SGD H	1.70%(f)
	Klasse A USD	1.70%(f)
	Klasse A USD H	1.70%(f)
	Klasse AD	1.70%(f)
	Klasse AD AUD H	1.70%(f)
	Klasse AD NZD H	1.70%(f)
	Klasse AD USD H	1.70%(f)
	Klasse AD ZAR H	1.70%(f)
	Klasse BD AUD H(e)	3.15%
	Klasse C	2.60%
	Klasse C EUR	2.60%
	Klasse C EUR H	2.60%
	Klasse C USD	2.60%
	Klasse I	0.90%(g)
	Klasse I EUR	0.90%(g)
	Klasse I EUR H	0.90%(g)
	Klasse I SGD	0.90%(g)
	Klasse I USD	0.90%(g)
	Klasse I USD H	0.90%(g)
	Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse S1 EUR	0.80%
	Klasse S1 USD	0.80%
	Klasse S1 USD H(a)	0.80%
	Klasse SD	0.15%
China Low Volatility Equity		
Portfolio	Klasse A	1.99%
	Klasse A EUR	1.99%
	Klasse A HKD	1.99%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
China Low Volatility Equity		
Portfolio (Fortsetzung)	Klasse A PLN H	1.99%
	Klasse AD	1.99%
	Klasse AD AUD H	1.99%
	Klasse AD CAD H	1.99%
	Klasse AD EUR H	1.99%
	Klasse AD GBP H	1.99%
	Klasse AD HKD	1.99%
	Klasse AD NZD H	1.99%
	Klasse AD RMB H(a)	1.99%
	Klasse AD SGD H	1.99%
	Klasse AD ZAR H	1.99%
	Klasse B	2.99%
	Klasse B EUR	2.99%
	Klasse BD NZD H	2.99%
	Klasse BD ZAR H(h)	2.99%
	Klasse C	2.44%
	Klasse C EUR	2.44%
	Klasse I	1.19%
	Klasse I EUR	1.19%
	Klasse S	0.16%
	Klasse S1	0.91%
	Klasse S1 EUR	0.91%
Short Duration Bond		
Portfolio	Klasse A	1.20%
	Klasse A EUR	1.20%
	Klasse A2	1.20%
	Klasse A2 EUR	1.20%
	Klasse A2 EUR H	1.20%
	Klasse A2 HKD	1.20%
	Klasse A2 SGD H(a)	1.20%
	Klasse AA	1.20%
	Klasse AA AUD H	1.20%
	Klasse AA CAD H	1.20%
	Klasse AA GBP H	1.20%
	Klasse AA HKD	1.20%
	Klasse AA NZD H(a)	1.20%
	Klasse AA SGD H	1.20%
	Klasse AJ	1.00%
	Klasse AR EUR H(a)	1.20%
	Klasse AT	1.20%
	Klasse AT AUD H	1.20%
	Klasse AT CAD H	1.20%
	Klasse AT EUR	1.20%
	Klasse AT EUR H	1.20%
	Klasse AT GBP H	1.20%
	Klasse AT HKD	1.20%
	Klasse AT NZD H	1.20%
	Klasse AT SGD H	1.20%
	Klasse AX	1.00%
	Klasse B	2.20%
	Klasse B2 EUR(i)	2.20%
	Klasse BT(j)	2.20%
	Klasse C	1.60%
	Klasse C2	1.60%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
Short Duration Bond			American Income Portfolio		
Portfolio (Fortsetzung)	Klasse C2 EUR H	1.60%	(Fortsetzung)	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(a)	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(a)	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(a)	0.10%		Klasse B2	2.20%
	Klasse S SGD H(a)	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(a)	0.35%		Klasse BA ZAR H(e)	2.20%
	Klasse SA	0.10%		Klasse BT	2.20%
				Klasse BT AUD H	2.20%
Global High Yield Portfolio . . .	Klasse S1	1.00%		Klasse BT CAD H	2.20%
	Klasse S1 EUR	1.00%		Klasse BT EUR(h)	2.20%
	Klasse S1D	1.00%		Klasse BT EUR H(k)	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%
				Klasse C	1.95%
American Income 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%
	Klasse AA EUR H	1.50%		Klasse I2 EUR	0.95%
	Klasse AA GBP H	1.50%		Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse AA HKD	1.50%		Klasse I2 HKD	0.95%
	Klasse AA NZD H	1.50%		Klasse I2 SGD	0.95%
	Klasse AA RMB H	1.50%		Klasse I2 SGD H	0.95%
	Klasse AA SGD H	1.50%		Klasse IA	0.95%
	Klasse AA ZAR H	1.50%		Klasse IA AUD H	0.95%
	Klasse AK	1.50%		Klasse IT	0.95%
	Klasse AK EUR	1.50%		Klasse IT AUD H	0.95%
	Klasse AK EUR H	1.50%		Klasse IT CAD H	0.95%
	Klasse AR EUR	1.50%		Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse AR EUR H	1.50%		Klasse IT GBP H	0.95%
	Klasse AT	1.50%		Klasse IT HKD	0.95%
				Klasse IT JPY	0.95%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
American Income Portfolio		
(Fortsetzung)	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(a)	1.05%
	Klasse L2 SGD H(a)	1.05%
	Klasse LT	1.05%
	Klasse LT AUD H(a)	1.05%
	Klasse LT SGD H(a)	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(a)	1.41%
	Klasse A2 USD	1.41%
	Klasse A2 USD H	1.41%
	Klasse AA	1.41%
	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%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
European Income Portfolio		
(Fortsetzung)	Klasse B2 USD	2.11%
	Klasse BA(l)	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(m)	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%
	Klasse WA USD H	0.86%
	Klasse WT	0.86%
	Klasse WT SGD H	0.86%
	Klasse WT USD H	0.86%
Emerging Markets Debt		
Portfolio	Klasse A	1.50%
	Klasse A EUR	1.50%
	Klasse A2	1.50%
	Klasse A2 CHF H	1.50%
	Klasse A2 EUR	1.50%
	Klasse A2 EUR H	1.50%
	Klasse A2 HKD	1.50%
	Klasse A2 PLN	1.50%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Emerging Markets Debt		
Portfolio (Fortsetzung)	Klasse A2 PLN H	1.50%
	Klasse A2 SGD H	1.50%
	Klasse AA	1.50%
	Klasse AA AUD H	1.50%
	Klasse AA CAD H	1.50%
	Klasse AA EUR H	1.50%
	Klasse AA GBP H	1.50%
	Klasse AA HKD	1.50%
	Klasse AA NZD H	1.50%
	Klasse AA RMB H	1.50%
	Klasse AA SGD H	1.50%
	Klasse AA ZAR H	1.50%
	Klasse AI	1.50%
	Klasse AI AUD H	1.50%
	Klasse AR EUR	1.50%
	Klasse AT	1.50%
	Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse AT CAD H	1.50%
	Klasse AT EUR	1.50%
	Klasse AT EUR H	1.50%
	Klasse AT GBP H	1.50%
	Klasse AT HKD	1.50%
	Klasse AT NZD H	1.50%
	Klasse AT RMB H(n)	1.50%
	Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse B2 EUR(e)	2.50%
	Klasse B2 HKD	2.50%
	Klasse BA(h)	2.50%
	Klasse BA AUD H(h)	2.50%
	Klasse BA ZAR H(e)	2.50%
	Klasse BT	2.50%
	Klasse BT AUD H(o)	2.50%
	Klasse BT EUR H(p)	2.50%
	Klasse BT HKD(c)	2.50%
	Klasse C	1.95%
	Klasse C EUR	1.95%
	Klasse C2	1.95%
	Klasse C2 EUR	1.95%
	Klasse C2 EUR H	1.95%
	Klasse CT	1.95%
	Klasse EA	2.00%
	Klasse EA AUD H	2.00%
	Klasse EA ZAR H	2.00%
	Klasse EI	2.00%
	Klasse EI AUD H	2.00%
	Klasse I	0.95%
	Klasse I2	0.95%
	Klasse I2 AUD H	0.95%
	Klasse I2 CHF H	0.95%
	Klasse I2 EUR	0.95%
	Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse IT AUD H	0.95%
	Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse IT SGD H(a)	0.95%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Emerging Markets Debt		
Portfolio (Fortsetzung)	Klasse N2	2.05%
	Klasse NT	2.05%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S EUR H(a)	0.15%
	Klasse S GBP H(a)	0.15%
	Klasse S1 2	0.70%
	Klasse S1 2 EUR	0.70%
	Klasse S1 EUR H	0.70%
	Klasse S1 GBP H	0.70%
	Klasse S1QD EUR H(q)	0.70%
	Klasse SA	0.15%
Mortgage Income		
Portfolio	Klasse A	1.50%
	Klasse A2	1.50%
	Klasse A2 EUR	1.50%
	Klasse A2 HKD	1.50%
	Klasse A2 SGD	1.50%
	Klasse A2X	1.25%
	Klasse A2X EUR	1.25%
	Klasse AA	1.50%
	Klasse AA AUD H	1.50%
	Klasse AA HKD	1.50%
	Klasse AA RMB H	1.50%
	Klasse AA SGD H	1.50%
	Klasse AA ZAR H	1.50%
	Klasse AR EUR H	1.50%
	Klasse AT	1.50%
	Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse AT EUR	1.50%
	Klasse AT GBP H	1.50%
	Klasse AT HKD	1.50%
	Klasse AT SGD	1.50%
	Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse AX	1.25%
	Klasse AX EUR	1.25%
	Klasse B2X(i)	1.70%
	Klasse BX	1.70%
	Klasse BX EUR	1.70%
	Klasse C	1.95%
	Klasse C2	1.95%
	Klasse C2 EUR	1.95%
	Klasse C2X(r)	1.70%
	Klasse CX	1.70%
	Klasse I	0.95%
	Klasse I EUR	0.95%
	Klasse I2	0.95%
	Klasse I2 EUR	0.95%
	Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse I2X(a)	0.70%
	Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse IX	0.70%
	Klasse N2	2.05%
	Klasse NT	2.05%
	Klasse S	0.15%

AB FCPI –	Anteilklasse	%
Mortgage Income Portfolio		
(Fortsetzung)	Klasse S1	0.65%
	Klasse S1 EUR	0.65%
	Klasse S1 EUR H	0.65%
	Klasse S1 JPY	0.65%
	Klasse SIX(a)	0.55%
	Klasse SA	0.15%

- (a) Die Anteilklasse wurde am 25. März 2022 aufgelöst.
- (b) Der letzte Nettoinventarwert wurde am 28. Januar 2022 berechnet. Siehe Anmerkung A.
- (c) Die Anteilklasse wurde am 29. Juli 2022 aufgelöst.
- (d) Die Anteilklasse wurde am 31. Mai 2022 aufgelöst.
- (e) Die Anteilklasse wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.
- (f) Im Laufe des Geschäftsjahres mit Wirkung zum 1. Januar 2022 von 2.15% auf 1.70% gesenkt.
- (g) Im Laufe des Geschäftsjahres mit Wirkung zum 1. Januar 2022 von 1.35% auf 0.90% gesenkt.
- (h) Die Anteilklasse wurde am 20. September 2021 aufgelöst.
- (i) Die Anteilklasse wurde am 24. Januar 2022 aufgelöst.
- (j) Die Anteilklasse wurde am 21. Januar 2022 aufgelöst.
- (k) Die Anteilklasse wurde am 31. August 2022 aufgelöst.
- (l) Die Anteilklasse wurde am 31. Januar 2022 aufgelöst.
- (m) Die Anteilklasse wurde am 22. November 2021 aufgelöst.
- (n) Die Anteilklasse wurde am 15. Juli 2022 aufgelöst.
- (o) Die Anteilklasse wurde am 31. Dezember 2021 aufgelöst.
- (p) Die Anteilklasse wurde am 30. Juni 2022 aufgelöst.
- (q) Die Anteilklasse wurde am 11. Oktober 2021 aufgelöst.
- (r) Die Anteilklasse wurde am 20. Oktober 2021 aufgelöst.

Folgende Tabelle gibt Aufschluss über die von der Verwaltungsgesellschaft getragenen Aufwendungen während des Geschäftsjahres zum 31. August 2022 und die Forderungen aus Aufwandserstattung zum 31. August 2022:

AB FCPI –	Getragene Aufwendungen	Forderungen aus Aufwands-erstattung
Dynamic Diversified Portfolio	\$ 339,238	72,788
Global Equity Blend Portfolio	\$ 108,379	34,023
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	\$ 1	0
Japan Strategic Value Portfolio	¥ 58,819,677	13,505,917
China Low Volatility Equity Portfolio	\$ 108,066	37,630
Short Duration Bond Portfolio	\$ 132,288	30,283
American Income Portfolio	\$ 159	3
Mortgage Income Portfolio	\$ 1,977	480

Die von der Verwaltungsgesellschaft getragenen Aufwendungen werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen“ verbucht. Forderungen aus Aufwandserstattung 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 Portfeuillees 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 Portfeuillees auf und werden monatlich entrichtet.

Die Jahressätze der betreffenden Gebühren für die einzelnen Portfeuillees 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 Portfeuille 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 das Geschäftsjahr zum 31. August 2022 belief sich dieser Betrag auf \$21,238,032.

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 das Geschäftsjahr zum 31. August 2022 belief sich dieser Betrag auf \$846,565. 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 Manager der Verwaltungsgesellschaft, bis zum 11. Februar 2022 Partner war) gegenüber dem Fonds erbrachte Rechtsdienste. Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2022 wurde eine Vergütung in Höhe von €46,266 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 das Geschäftsjahr zum 31. August 2022 wurden keine Provisionen für Wertpapiertransaktionen unter Beanspruchung der Dienste der Tochtergesellschaften, Sanford C. Bernstein & Co., LLC und 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 – Sustainable Euro High Yield Portfolio, das AB SICAV I – Asia Income Opportunities Portfo-

lio, 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 Portfo-

lio investiert in das AB SICAV I – Emerging Market Corporate Debt Portfolio, das von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet wird.

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

ANMERKUNG F: Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen und Transaktionskosten

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2022 haben der Anlageverwalter und eventuelle verbundene Unterverwalter, 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 delegiert, alle Kosten im Zusammenhang mit Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen „entflochten“ und vom Anlageverwalter oder seinen Unterbeauftragten getragen werden, falls dies nach geltendem Recht erforderlich ist.

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

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

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

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

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

In der folgenden Tabelle sind die Transaktionskosten, die für die einzelnen Portefeuilles im Geschäftsjahr zum 31. August 2022 angefallen sind, aufgeführt:

AB FCPI-	Transaktionskosten
Dynamic Diversified Portfolio	\$ 17,582
Global Equity Blend Portfolio	\$ 85,636
Global Value Portfolio	\$ 775,486
Emerging Markets Growth Portfolio	\$ 1,072,661
Sustainable US Thematic Portfolio(a)	\$ 28,886
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	\$ 1,554,213
Japan Strategic Value Portfolio	¥ 7,059,919
China Low Volatility Equity Portfolio	\$ 243,629
Short Duration Bond Portfolio	\$ 25,813
Global High Yield Portfolio	\$ 260,872
American Income Portfolio	\$ -0-
European Income Portfolio	€ 29,263
Emerging Markets Debt Portfolio	\$ -0-
Mortgage Income Portfolio	\$ 2,374

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

ANMERKUNG G: Devisentermingeschäfte

Ein Devisentermingeschäft ist eine Verpflichtung zu einem späteren Kauf oder Verkauf einer Fremdwährung zu einem vereinbarten Terminsatz. Der Gewinn bzw. Verlust, der sich aus dem Unterschied zwischen dem ursprünglichen Vertrag und der Glattstellung dieses Vertrags ergibt, wird in der Ertrags- und

Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Realisierte Gewinne und Verluste aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ verbucht.

Wertschwankungen offener Devisenterminkontrakte werden zu Finanzberichterstattungszwecken unter „Unrealisierte Wert-

steigerung/(-minderung) aus Devisenterminkontrakten“ in der Vermögensaufstellung berücksichtigt.

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

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

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.

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 Portefeuille-Wertpapiere investiert wurde, während der Laufzeit des Pensionsgeschäfts vollständig oder größtenteils

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, erforderliche Sicherheitsleistung in Form einer Einschusszahlung.

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

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.

Zum 31. August 2022 gab es keine Pensionsgeschäfte.

Während des Geschäftsjahres zum 31. August 2022 wurden keine Zinserträge aus Pensionsgeschäften verzeichnet.

zurückzuerlangen und gleichzeitig die Zinserträge, die mit diesen Portefeuille-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 Portefeuille-Wertpapiere investiert ist.

Zum 31. August 2022 bestanden keine umgekehrten Pensionsgeschäfte.

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2022 gab es keine Zinserträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften.

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 Glatstellung des Kontrakts weist der Fonds in Höhe des Unterschieds zwischen dem Wert des Kontrakts bei Abschluss und bei der Glatstellung einen realisierten Gewinn bzw. Verlust aus.

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

Inflationsswap

Ein 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 Gattstellungstransaktion, einschließlich Händlerprovisionen, wird ebenfalls als realisierter Gewinn behandelt, bzw. als realisierter Verlust, wenn die erhaltene Prämie geringer ist als der bezahlte Betrag für die Gattstellungstransaktion.

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 31. August 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.....		
Citibank	\$ 18,490	–
Morgan Stanley	\$ 340,786	19,663

AB FCPI –	Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker zu entrichtende Barmittel
Global Equity Blend Portfolio.....		
Citibank	\$ 14,496	18,108
Deutsche Bank	\$ 42,036	17,074
Standard Chartered Bank	\$ –	25,406
Global Value Portfolio		
Citibank	\$ –	261,892
Deutsche Bank	\$ 607,965	–
Standard Chartered Bank	\$ –	252,539

AB FCPI –	Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker zu entrichtende Barmittel
Short Duration Bond		
Portfolio		
Citibank	\$ 909,506	351,146
HSBC Bank	\$ 7,803	-
Morgan Stanley	\$ 3,208,684	-
Global High Yield Portfolio		
Barclays	\$ -	280,000
BNP Paribas	\$ 62,000	-
Citibank	\$ 13,192,012	-
Goldman Sachs	\$ 250,000	-
JPMorgan Chase	\$ 35,015,001	-
Morgan Stanley	\$ 14,210,050	9,478,912
American Income Portfolio		
Citibank	\$ 47,990,000	12,323,411
Credit Suisse	\$ 2,960,000	-
Deutsche Bank	\$ -	12,286,932
Goldman Sachs	\$ 3,310,000	-
JPMorgan Chase	\$ 49,045,000	-
Morgan Stanley	\$ 80,127,862	-
European Income Portfolio		
Citibank	€ 9,202,091	12,129
Goldman Sachs	€ 7,428,111	872,921
Emerging Markets Debt		
Portfolio		
Goldman Sachs	\$ 303,829	-
Morgan Stanley	\$ 14,092,083	-
Mortgage Income Portfolio		
Citibank	\$ 2,930,705	-
Credit Suisse	\$ 1,031,400	-
Goldman Sachs	\$ 467,000	-
JPMorgan Chase	\$ 2,248,000	-
Morgan Stanley	\$ 1,934,525	510,484

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 31. August 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
Global High Yield Portfolio		
BNP Paribas		
U.S. Treasury Notes, 2.88%, 05/15/2032	\$ 1,159,120	-
Citibank		
U.S. Treasury Notes, 2.88%, 05/15/2032	\$ 48,591,232	-
Credit Suisse		
U.S. Treasury Notes, 1.88%, 02/15/2032	\$ 89,044	-
Credit Suisse		
U.S. Treasury Notes, 2.88%, 05/15/2032	\$ 23,195,195	-
Deutsche Bank		
U.S. Treasury Notes, 2.88%, 05/15/2032	\$ 4,472,649	-
Goldman Sachs		
U.S. Treasury Notes, 2.88%, 05/15/2032	\$ 55,707,725	-
Morgan Stanley		
U.S. Treasury Bonds, 6.75%, 08/15/2026	\$ 238,950,459	-
U.S. Treasury Notes, 1.88%, 02/15/2032	\$ 22,417,970	-
U.S. Treasury Notes, 2.88%, 05/15/2032	\$ 41,921,065	-
American Income Portfolio . . .		
Barclays		
U.S. Treasury Bonds, 6.25%, 05/15/2030	\$ 5,720,738	-
Citibank		
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 08/15/2029	\$ 235,375,000	-
U.S. Treasury Bonds, 6.25%, 05/15/2030	\$ 31,669,931	-
Credit Suisse		
U.S. Treasury Bonds, 6.25%, 05/15/2030	\$ 10,001,982	-
Goldman Sachs		
U.S. Treasury Bonds, 6.25%, 05/15/2030	\$ 32,424,381	-
Morgan Stanley		
U.S. Treasury Bonds, 6.25%, 05/15/2030	\$ 19,385,679	-

ANMERKUNG N: Verleih von Portefeuille-Wertpapieren

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

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

Während die Wertpapiere verliehen sind, zahlt der Entleiher dem jeweiligen Portefeuille möglicherweise alle aus diesen Wertpapieren generierten Erträge. Das Portefeuille kann alle Barsicherheiten in Geldmarktinstrumente investieren und dadurch zusätzliche Erträge erwirtschaften oder aber einen vereinbarten Betrag

an Erträgen von einem Entleiher erhalten, der entsprechende Sicherheiten geliefert hat.

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

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

Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2022 erwirtschafteten die Portefeuilles Nettogebühreneinnahmen, die in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erträge aus der Wertpapierleihe, netto“ ausgewiesen sind.

Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2022 verdiente Brown Brothers Harriman & Co. (in seiner Funktion als Wertpapierleihstelle) ein Honorar von \$45,184 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 31. August 2022 verliehenen Wertpapiere und die entsprechenden ausstehenden Sicherheiten haben folgenden Wert. Die Sicherheiten beziehen sich auf die in den Portefeuilles gehaltenen Wertpapiere.

AB FCPI –	Wert	Marktwert der Sicherheiten
Global Equity Blend		
Portfolio		
Societe Generale	\$ 310,593	326,223
Merrill Lynch	\$ 152,423	162,088

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.

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 Anteilhaber 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.

AB FCPI –	Wert	Marktwert der Sicherheiten
JPMorgan Chase	\$ 49,436	51,961
UBS AG	\$ 32,957	34,693
Global Value Portfolio		
Societe Generale	\$ 4,492,132	4,718,200
Merrill Lynch	\$ 2,204,515	2,344,294
JPMorgan Chase	\$ 714,998	751,513
UBS AG	\$ 476,665	501,756
Emerging Markets Growth		
Portfolio		
Merrill Lynch	\$ 1,962,505	2,086,937
JPMorgan Chase	\$ 456,960	480,298
Asia Ex-Japan Equity		
Portfolio		
BNP Paribas	\$ 3,192,683	18,423,241
Merrill Lynch	\$ 1,291,140	1,373,004
JPMorgan Chase	\$ 1,243,725	1,307,244
Japan Strategic Value		
Portfolio		
Merrill Lynch	¥ 422,127,626	448,892,589
Citigroup Global		
Markets Limited	¥ 139,906,550	147,203,199
China Low Volatility		
Equity Portfolio		
UBS AG	\$ 1,028,610	1,082,756
Merrill Lynch	\$ 696,483	740,644
Citigroup Global		
Markets Limited	\$ 511,699	538,386
BNP Paribas	\$ 324,120	1,870,319

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.

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

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

Zum 31. August 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

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Dynamic Diversified Portfolio***				
Klasse				
A	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
A EUR	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
A EUR H	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
AX	1.40%	0.10%	N/A	1.90%
AX EUR	1.40%	0.10%	N/A	1.90%
AX SGD	1.40%	0.10%	N/A	1.90%
BX	1.40%	0.10%	1.00%	2.90%
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(a)	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
Global Equity Blend Portfolio				
Klasse				
A	1.60%	0.10%	N/A	2.07%
A EUR	1.60%	0.10%	N/A	2.07%
A EUR H	1.60%	0.10%	N/A	2.06%
A SGD	1.60%	0.10%	N/A	2.06%
B	1.60%	0.10%	1.00%	3.06%
B SGD	1.60%	0.10%	1.00%	3.06%
C	2.05%	0.10%	N/A	2.51%
C EUR	2.05%	0.10%	N/A	2.49%
I	0.80%	0.10%	N/A	1.27%
I EUR	0.80%	0.10%	N/A	1.29%
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%
Global Value Portfolio				
Klasse				
A	1.50%	0.10%	N/A	1.76%
A EUR	1.50%	0.10%	N/A	1.78%
A SGD	1.50%	0.10%	N/A	1.77%
A SGD H	1.50%	0.10%	N/A	1.78%
AD	1.50%	0.10%	N/A	1.77%
AD AUD H	1.50%	0.10%	N/A	1.77%
AD CAD H	1.50%	0.10%	N/A	1.77%
AD EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.77%
AD GBP H	1.50%	0.10%	N/A	1.77%
AD HKD	1.50%	0.10%	N/A	1.77%
AD SGD H(a)	1.50%	0.10%	N/A	1.74%
AD ZAR H	1.50%	0.10%	N/A	1.77%
B	1.50%	0.10%	1.00%	2.78%
BD(b)	1.50%	0.10%	1.00%	2.77%
C	1.95%	0.10%	N/A	2.23%
C EUR	1.95%	0.10%	N/A	2.22%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Global Value Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
I	0.70%	0.10%	N/A	0.94%
I EUR	0.70%	0.10%	N/A	0.93%
I GBP	0.70%	0.10%	N/A	1.00%
I SGD	0.70%	0.10%	N/A	0.99%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S GBP	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S GBP H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S1	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.79%
S1 EUR	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.77%
S1 GBP	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
SD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
Emerging Markets Growth Portfolio				
Klasse				
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	2.01%
A PLN H	1.70%	0.10%	N/A	2.00%
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(a)	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	1.20%
N	2.15%	0.10%	N/A	2.43%
S(a)	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	0.96%
S1 GBP	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.97%
Sustainable US Thematic Portfolio**				
Klasse				
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 GBP H	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%
I	0.70%	0.05%	N/A	0.87%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Sustainable US Thematic Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
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%
Asia Ex-Japan Equity Portfolio				
Klasse				
A	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
A AUD H	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
A EUR	1.70%	0.05%	N/A	2.02%
A HKD	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
A SGD H	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
AD	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD AUD H	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
AD CAD H	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
AD EUR	1.70%	0.05%	N/A	2.01%
AD EUR H	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
AD GBP H	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
AD HKD	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
AD NZD H	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
AD RMB H	1.70%	0.05%	N/A	1.98%
AD SGD H(a)	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	2.00%
BD	1.70%	0.05%	1.00%	3.00%
BD AUD H	1.70%	0.05%	1.00%	3.00%
BD CAD H(c)	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
BD HKD	1.70%	0.05%	1.00%	3.00%
BD NZD H(d)	1.70%	0.05%	1.00%	3.00%
BD ZAR H(e)	1.70%	0.05%	1.00%	2.98%
BY JPY	1.45%	0.05%	0.72%	2.47%
C	2.15%	0.05%	N/A	2.45%
C AUD H(a)	2.15%	0.05%	N/A	2.43%
C EUR	2.15%	0.05%	N/A	2.43%
ED	1.70%	0.05%	1.00%	3.00%
ED AUD H	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
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	1.17%
I GBP	0.90%	0.05%	N/A	1.20%
ID(a)	0.90%	0.05%	N/A	1.20%
ID AUD H(a)	0.90%	0.05%	N/A	1.18%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.15%
S HKD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.15%
S1	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.06%
S1 EUR	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.02%
SD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.16%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
--	------------------------	-------------------------------------	--------------------------	-------------------------

Japan Strategic Value Portfolio

Klasse	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
A	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A AUD H(a)	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A CZK H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A EUR	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A EUR H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A NZD H(a)	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(e)	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(a)	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.80%
SD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.15%

China Low Volatility Equity Portfolio

Klasse	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
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(a)	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(b)	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
C	2.15%	0.05%	N/A	2.44%
C EUR	2.15%	0.05%	N/A	2.44%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
China Low Volatility Equity Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
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%
Short Duration Bond Portfolio				
Klasse				
A	0.85%	0.10%	N/A	1.19%
A EUR	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
A2	0.85%	0.10%	N/A	1.19%
A2 EUR	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
A2 EUR H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
A2 HKD	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
A2 SGD H(a)	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AA	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AA AUD H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AA CAD H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AA GBP H	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AA HKD	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AA NZD H(a)	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	0.98%
AR EUR H(a)	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT AUD H	0.85%	0.10%	N/A	1.19%
AT CAD H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT EUR	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT EUR H	0.85%	0.10%	N/A	1.19%
AT GBP H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT HKD	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT NZD H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AT SGD H	0.85%	0.10%	N/A	1.18%
AX	0.65%	0.10%	N/A	0.98%
B	0.85%	0.10%	1.00%	2.18%
B2 EUR(f)	0.85%	0.10%	1.00%	2.13%
BT(g)	0.85%	0.10%	1.00%	2.14%
C	1.25%	0.10%	N/A	1.58%
C2	1.25%	0.10%	N/A	1.58%
C2 EUR H	1.25%	0.10%	N/A	1.55%
I	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
I EUR	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
I2	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
I2 AUD H(a)	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
I2 EUR	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
I2 EUR H	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
IT	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
IT AUD H(a)	0.325%	0.10%	N/A	0.57%
N2	1.35%	0.10%	N/A	1.68%
NT	1.35%	0.10%	N/A	1.68%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S EUR H(a)	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S SGD H(a)	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%
S1 2	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
I S1 2 EUR	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
S1 EUR H(a)	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
Global High Yield Portfolio***				
Klasse				
A	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
A EUR	1.40%(1)	0.10%	N/A	1.62%
A2	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
A2 CHF H	1.40%(1)	0.10%	N/A	1.62%
A2 EUR	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
A2 EUR H	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.59%
A2 HKD	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.61%
A2 PLN H	1.40%(1)	0.10%	N/A	1.63%
A2 SGD	1.38%(1)	0.10%	N/A	1.60%
A2 SGD H	1.40%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AA	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AA AUD H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AA CAD H	1.40%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AA EUR H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AA GBP H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AA HKD	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AA NZD H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AA RMB H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AA SGD H	1.40%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AA ZAR H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AK	1.40%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AK EUR	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AK EUR H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.61%
AR EUR H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AT	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AT AUD H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AT CAD H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AT EUR	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AT EUR H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AT GBP H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AT HKD	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AT NZD H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AT RMB H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AT SGD	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
AT SGD H	1.39%(1)	0.10%	N/A	1.62%
B	1.40%(1)	0.10%	1.00%	2.62%
B2	1.40%(1)	0.10%	1.00%	2.62%
BA(h)	1.38%(1)	0.10%	1.00%	2.60%
BA AUD H	1.38%(1)	0.10%	1.00%	2.59%
BA ZAR H(e)	1.36%(1)	0.10%	1.00%	2.59%
BT	1.39%(1)	0.10%	1.00%	2.62%
BT AUD H	1.39%(1)	0.10%	1.00%	2.62%
BT CAD H(i)	1.39%(1)	0.10%	1.00%	2.62%
BT EUR H(j)	1.36%(1)	0.10%	1.00%	2.55%
BT GBP H(i)	1.39%(1)	0.10%	1.00%	2.62%
BT HKD	1.39%(1)	0.10%	1.00%	2.62%
BT NZD H	1.38%(1)	0.10%	1.00%	2.39%
C	1.89%(2)	0.10%	N/A	2.12%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Global High Yield Portfolio*** (Fortsetzung)				
Klasse				
C EUR	1.90%(2)	0.10%	N/A	2.11%
C2	1.89%(2)	0.10%	N/A	2.11%
C2 EUR	1.89%(2)	0.10%	N/A	2.12%
C2 EUR H	1.89%(2)	0.10%	N/A	2.12%
CK	1.90%(2)	0.10%	N/A	2.12%
CK EUR H	1.90%(2)	0.10%	N/A	2.09%
CT	1.90%(2)	0.10%	N/A	2.12%
EA	1.39%(1)	0.10%	0.50%	2.12%
EA AUD H	1.39%(1)	0.10%	0.50%	2.12%
EA ZAR H	1.39%(1)	0.10%	0.50%	2.12%
I	0.89%(3)	0.10%	N/A	1.12%
I EUR	0.90%(3)	0.10%	N/A	1.12%
I2	0.89%(3)	0.10%	N/A	1.12%
I2 AUD H	0.90%(3)	0.10%	N/A	1.12%
I2 CHF H	0.89%(3)	0.10%	N/A	1.11%
I2 EUR	0.90%(3)	0.10%	N/A	1.12%
I2 EUR H	0.89%(3)	0.10%	N/A	1.12%
I2 SGD	0.90%(3)	0.10%	N/A	1.12%
I2 SGD H	0.90%(3)	0.10%	N/A	1.12%
IA AUD H	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.10%
IQD	0.89%(3)	0.10%	N/A	1.11%
IQD EUR	0.89%(3)	0.10%	N/A	1.11%
IT	0.89%(3)	0.10%	N/A	1.11%
IT AUD H	0.89%(3)	0.10%	N/A	1.12%
IT CAD H	0.89%(3)	0.10%	N/A	1.12%
IT EUR H	0.89%(3)	0.10%	N/A	1.12%
IT GBP H	0.90%(3)	0.10%	N/A	1.12%
IT HKD	0.90%(3)	0.10%	N/A	1.12%
IT NZD H(a)	0.88%(3)	0.10%	N/A	1.10%
IT RMB H	0.90%(3)	0.10%	N/A	1.12%
J	1.39%(1)	0.10%	1.00%	2.62%
N2	1.95%(4)	0.10%	N/A	2.17%
NT	1.95%(4)	0.10%	N/A	2.17%
S1	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.94%
S1 EUR	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.92%
S1D	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.94%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
SK	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.69%
W	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
W EUR	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.95%
W2	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
W2 CHF H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
W2 EUR H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
WT AUD H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
WT CAD H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
WT EUR H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
WT GBP H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
WT RMB H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%

American Income Portfolio***

Klasse				
A	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.31%

American Income Portfolio* (Fortsetzung)**

Klasse	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
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	1.31%
A2 EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
A2 HKD	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 PLN H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 SGD	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
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	1.31%
AA EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA GBP H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA HKD	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA NZD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA RMB H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA ZAR H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AK	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AK EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AK EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AR EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
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	1.31%
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%	2.01%
BA AUD H	1.10%	0.10%	0.70%	2.01%
BA ZAR H(e)	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(b)	1.10%	0.10%	0.70%	2.05%
BT EUR H(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%	2.01%
C	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C EUR	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C2	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C2 DUR PH	1.55%	0.10%	N/A	1.77%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
American Income Portfolio*** (Fortsetzung)				
Klasse				
C2 EUR	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C2 EUR H	1.55%	0.10%	N/A	1.76%
CT	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
EA	1.10%	0.10%	0.50%	1.82%
EA AUD H	1.10%	0.10%	0.50%	1.82%
EA ZAR H	1.10%	0.10%	0.50%	1.82%
I	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I EUR	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 AUD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 CHF H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 DUR PH	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
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	0.77%
I2 SGD	0.55%	0.10%	N/A	0.74%
I2 SGD H	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IA	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IA AUD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT AUD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT CAD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT EUR H	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT GBP H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
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	0.76%
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	0.77%
IT SGD H	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
J	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
L2	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
L2 AUD H(a)	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
L2 SGD H(a)	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
LT	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
LT AUD H(a)	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
LT SGD H(a)	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
N2	1.65%	0.10%	N/A	1.87%
NT	1.65%	0.10%	N/A	1.86%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
S1	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.54%
S1 EUR	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.54%
S1D	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.54%
S1D2	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.54%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
W	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
W2	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
W2 CHF H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
W2 EUR H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WT	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WT AUD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WT EUR H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WT GBP H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
American Income Portfolio*** (Fortsetzung)				
Klasse				
WT HKD	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WT SGD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
European Income Portfolio				
Klasse				
A	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
A USD	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 PLN H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
A2 SGD H(a)	1.10%	0.10%	N/A	1.28%
A2 USD	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
A2 USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AA AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA HKD H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AA RMB H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AK	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AR	1.10%	0.10%	N/A	1.33%
AT	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT USD	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
B USD	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
B2	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
B2 USD	1.10%	0.10%	0.70%	2.01%
BA(k)	1.10%	0.10%	0.70%	1.96%
BA AUD H	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BA USD H	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BT	1.10%	0.10%	0.70%	1.99%
BT AUD H	1.10%	0.10%	0.70%	1.99%
BT USD(l)	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BT USD H	1.10%	0.10%	0.70%	2.01%
C	1.55%	0.10%	N/A	1.75%
C USD	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C2	1.55%	0.10%	N/A	1.76%
C2 USD	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C2 USD H	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
CK	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
CT USD H	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
I	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
I USD	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
I2	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
I2 AUD H	0.55%	0.10%	N/A	0.85%
I2 CHF H	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
I2 USD	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
I2 USD H	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IA	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IA HKD H	0.55%	0.10%	N/A	0.73%
IA SGD H	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
IA USD H	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
IT	0.55%	0.10%	N/A	0.77%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	<u>Verwaltungs- gebühr</u>	<u>Verwaltungsgesellschafts- gebühr</u>	<u>Ausschüttungs- gebühr</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
European Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
IT SGD H	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
IT USD H	0.55%	0.10%	N/A	0.74%
NT USD H	1.65%	0.10%	N/A	1.87%
S1	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.55%
S1 USD	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.54%
S1 USD H	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.55%
S1D	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.55%
SA USD H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.05%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.05%
W2	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
W2 CHF H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
W2 USD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
WA	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WA HKD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.57%
WA USD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.63%
WT	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WT SGD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.57%
WT USD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.63%
Emerging Markets Debt Portfolio***				
Klasse				
A	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
A EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
A2 CHF H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2 EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
A2 EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
A2 HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
A2 PLN	1.10%	0.05%	N/A	1.38%
A2 PLN H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
A2 SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AA HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA NZD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA RMB H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AA ZAR H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AI	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AI AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AR EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT NZD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT RMB H(m)	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
B2 EUR(e)	1.10%	0.05%	1.00%	2.31%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Emerging Markets Debt Portfolio*** (Fortsetzung)				
Klasse				
B2 HKD	1.10%	0.05%	1.00%	2.35%
BA(b)	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BA AUD H(b)	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BA ZAR H(e)	1.10%	0.05%	1.00%	2.25%
BT	1.10%	0.05%	1.00%	2.35%
BT AUD H(n)	1.10%	0.05%	1.00%	2.30%
BT EUR H(i)	1.10%	0.05%	1.00%	2.35%
BT HKD(c)	1.10%	0.05%	1.00%	2.35%
C	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
C EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
C2 EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
C2 EUR H	1.55%	0.05%	N/A	1.79%
CT	1.55%	0.05%	N/A	1.79%
EA	1.10%	0.05%	0.50%	1.85%
EA AUD H	1.10%	0.05%	0.50%	1.85%
EA ZAR H	1.10%	0.05%	0.50%	1.85%
EI	1.10%	0.05%	0.50%	1.85%
EI AUD H	1.10%	0.05%	0.50%	1.85%
I	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.79%
I2 AUD H	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
I2 CHF H	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
I2 EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.79%
IT AUD H	0.55%	0.05%	N/A	0.79%
IT EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
IT SGD H(a)	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
N2	1.65%	0.05%	N/A	1.90%
NT	1.65%	0.05%	N/A	1.90%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.12%
S EUR H(a)	N/A	0.01%(8)	N/A	0.08%
S GBP H(a)	N/A	0.01%(8)	N/A	0.08%
S1 2	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.68%
S1 2 EUR	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.63%
S1 EUR H	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.64%
S1 GBP H	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.64%
S1QD EUR H(o)	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.66%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.13%

Mortgage Income Portfolio

Klasse				
A	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2 EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
A2 HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2 SGD	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2X	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
A2X EUR	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
AA	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA RMB H	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AA SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.31%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	<u>Verwaltungs- gebühr</u>	<u>Verwaltungsgesellschafts- gebühr</u>	<u>Ausschüttungs- gebühr</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AA ZAR H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AR EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AT AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AT EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AT GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AT HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AT SGD	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AX	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
AX EUR	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
B2X(f)	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	1.77%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.78%
C2 EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.76%
C2X(p)	1.50%(6)	0.05%	N/A	1.70%
CX	1.50%(6)	0.05%	N/A	1.70%
I	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
I EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
I2 EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.76%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
I2X(a)	0.50%(7)	0.05%	N/A	0.70%
IT EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
IX	0.50%(7)	0.05%	N/A	0.70%
N2	1.65%	0.05%	N/A	1.88%
NT	1.65%	0.05%	N/A	1.87%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.08%
S1	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
S1 EUR	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.57%
S1 EUR H	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.57%
S1 JPY	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
S1X(a)	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 Nettoinventarwert wurde am 28. Januar 2022 berechnet. Siehe Anmerkung A.

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

- (a) Die Anteilklasse wurde am 25. März 2022 aufgelöst.
- (b) Die Anteilklasse wurde am 20. September 2021 aufgelöst.
- (c) Die Anteilklasse wurde am 29. Juli 2022 aufgelöst.
- (d) Die Anteilklasse wurde am 31. Mai 2022 aufgelöst.
- (e) Die Anteilklasse wurde am 20. Dezember 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. August 2022 aufgelöst.
- (i) Die Anteilklasse wurde am 30. Juni 2022 aufgelöst.

- (j) Die Anteilklasse wurde am 30. November 2021 aufgelöst.
- (k) Die Anteilklasse wurde am 31. Januar 2022 aufgelöst.
- (l) Die Anteilklasse wurde am 22. November 2021 aufgelöst.
- (m) Die Anteilklasse wurde am 15. Juli 2022 aufgelöst.
- (n) Die Anteilklasse wurde am 31. Dezember 2021 aufgelöst.
- (o) Die Anteilklasse wurde am 11. Oktober 2021 aufgelöst.
- (p) 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 FCP I

	Umsatz*
AB FCP I–	
Dynamic Diversified Portfolio	159.25%
Global Equity Blend Portfolio	113.86%
Global Value Portfolio	73.20%
Emerging Markets Growth Portfolio	71.00%
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	61.69%
Japan Strategic Value Portfolio	16.16%
China Low Volatility Equity Portfolio	-9.37%
Short Duration Bond Portfolio	135.39%
Global High Yield Portfolio	-4.56%
American Income Portfolio	-3.75%
European Income Portfolio	34.08%
Emerging Markets Debt Portfolio	117.59%
Mortgage Income Portfolio	-28.86%

* Ungeprüft.

An die Anteilhaber von AB FCP I

Bestätigungsvermerk

Wir haben den Jahresabschluss von AB FCP I (der „Fonds“) und der einzelnen Portefeuilles geprüft, der aus der Zusammensetzung des Fondsvermögens und dem Verzeichnis der Anlagewerte zum 31. August 2022, der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens für das zu diesem Zeitpunkt abgelaufene Geschäftsjahr und den Anmerkungen zum Jahresabschluss, darunter eine Zusammenfassung der relevanten Bilanzierungsgrundsätze, besteht.

Wir sind der Ansicht, dass der Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den gesetzlichen und aufsichtsbehördlichen Vorschriften Luxemburgs für die Erstellung und Präsentation von Jahresabschlüssen eine wahrheitsgetreue und angemessene Darstellung der finanziellen Lage des Fonds und jedes seiner Portefeuilles zum 31. August 2022 sowie der Ergebnisse seiner Investitionstätigkeit und der Entwicklung seines Nettovermögens für das zu diesem Zeitpunkt ablaufende Geschäftsjahr liefert.

Grundlage für den Bestätigungsvermerk

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über die Prüfungstätigkeit (das „Gesetz vom 23. Juli 2016“) und den in Luxemburg von der „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ (CSSF) umgesetzten Internationalen Abschlussprüfungsgrundsätzen (ISA) durchgeführt. Unsere Pflichten im Rahmen des Gesetzes vom 23. Juli 2016 und der ISA, die von der CSSF für Luxemburg übernommen wurden, sind im Abschnitt „Pflichten des „réviseur d'entreprises agréé“ in Bezug auf die Prüfung des Abschlusses“ in unserem Bericht näher beschrieben. Wir sind zudem gemäß dem vom International Ethics Standards Board for Accountants herausgegebenen International Code of Ethics for Professional Accountants, einschließlich der International Independence Standards („IESBA-Kodex“), in der von der CSSF für Luxemburg angenommenen Form sowie den für unsere Prüfung des Abschlusses relevanten ethischen Anforderungen von dem Fonds unabhängig und haben unsere sonstigen ethischen Verpflichtungen gemäß diesen ethischen Anforderungen erfüllt. Nach unserer Auffassung sind die erhaltenen Prüfungsnachweise als Grundlage für die Erteilung unseres Bestätigungsvermerks ausreichend und angemessen.

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft (der „Verwaltungsrat“) ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, jedoch nicht den Abschluss und unseren dazugehörigen Bericht des „réviseur d'entreprises agréé“.

Unser Bestätigungsvermerk zum Abschluss bezieht sich nicht auf die sonstigen Informationen und wir geben keinerlei Art von Prüfungsurteil hinsichtlich der Zuverlässigkeit der sonstigen Informationen ab.

In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses sind wir dafür verantwortlich, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob die sonstigen Informationen wesentlich im Widerspruch zum Abschluss oder zu unserem bei der Abschlussprüfung erlangten Wissen stehen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Wenn wir aufgrund der von uns durchgeführten Arbeit zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informa-

tionen vorliegt, müssen wir über diese Tatsache berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats für den Abschluss

Der Verwaltungsrat ist für die Aufstellung und sachgerechte Darstellung dieses Abschlusses in Übereinstimmung mit den gesetzlichen und aufsichtsbehördlichen Vorschriften Luxemburgs in Bezug auf die Erstellung und Darstellung des Abschlusses verantwortlich, sowie für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat für erforderlich hält, um die Erstellung von Abschlüssen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses ist der Verwaltungsrat dafür verantwortlich, die Fähigkeit des Fonds und jedes seiner Portefeuilles zur Unternehmensfortführung zu bewerten, wobei er gegebenenfalls Fragen im Zusammenhang mit der Unternehmensfortführung offenlegt und die Rechnungslegung auf dem Grundsatz der Unternehmensfortführung vornimmt, es sei denn, der Verwaltungsrat beabsichtigt, den Fonds oder eines seiner Portefeuilles zu liquidieren oder seine Geschäftstätigkeit einzustellen, oder er hat keine realistische Alternative, als so zu handeln.

Pflichten des „réviseur d'entreprises agréé“ in Bezug auf die Prüfung des Abschlusses

Das Ziel unserer Prüfung ist es, eine angemessene Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss insgesamt frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, und einen Bericht des „réviseur d'entreprises agréé“ zu erstellen, der unseren Bestätigungsvermerk enthält. Die angemessene Sicherheit stellt einen hohen Grad an Sicherheit dar, ist jedoch keine Garantie dafür, dass bestehende wesentliche falsche Darstellungen bei einer gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den in Luxemburg von der CSSF umgesetzten ISA durchgeführten Abschlussprüfung immer entdeckt werden. Falsche Darstellungen können durch dolose Handlungen oder Irrtümer entstehen und gelten als wesentlich, wenn vernünftigerweise erwartet werden kann, dass sie einzeln oder insgesamt die wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen, die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffen werden.

Im Rahmen unserer Abschlussprüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den in Luxemburg von der CSSF umgesetzten ISA gehen wir während der gesamten Abschlussprüfung nach pflichtgemäßem Ermessen und mit professioneller Skepsis vor. Des Weiteren umfasst unsere Prüfung:

- Die Identifizierung und Beurteilung des Risikos wesentlicher falscher Darstellungen im Abschluss aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, die Planung und Durchführung von Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken und die Erlangung von Prüfungsnachweisen, die als Grundlage für die Erteilung unseres Bestätigungsvermerks ausreichend und angemessen sind. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen nicht entdeckt werden, ist höher als bei wesentlichen falschen Darstellungen, die aus Irrtümern resultieren, da dolose Handlungen geheime Absprachen, Fälschungen, gezielte Auslassungen, falsche Angaben wesentlicher Umstände oder die Umgehung interner Kontrollen beinhalten können.

- Erlangung eines Verständnisses der für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollen, um den Umständen angemessene Prüfungsverfahren zu erarbeiten, jedoch nicht, um eine Meinung über die Wirksamkeit der internen Kontrollen des Fonds abzugeben.
- Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden und der Angemessenheit der vom Verwaltungsrat vorgenommenen Schätzungen in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.
- Abschließende Feststellung, ob die Anwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung bei der Rechnungslegung durch den Verwaltungsrat angemessen ist und ob auf Basis der erlangten Prüfungsnachweise eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Bedingungen besteht, die erhebliche Zweifel an der Fähigkeit des Fonds oder eines seiner Portefeuilles zur Unternehmensfortführung aufwerfen könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Bericht des „réviseur d'entreprises agréé“ auf die entsprechenden Offenlegungen im Abschluss hinzuweisen bzw. unseren Bestätigungsvermerk zu ändern, falls die Offenlegungen unangemessen sind. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den bis zum Datum des Berichts des „réviseur d'entreprises agréé“ erlangten Prüfungsnachweisen. Allerdings können zukünftige Ereignisse oder Bedingungen dazu führen, dass der Fonds oder eines seiner Portefeuilles nicht mehr fortgeführt werden kann.
- In Bezug auf das Portefeuille, dessen Schließung beschlossen wurde oder beabsichtigt ist, stellen wir abschließend fest, ob die Abkehr von der Fortführungsannahme bei der Rechnungslegung angemessen ist. Wir bewerten auch die

Angemessenheit der Angaben, in denen die Rechnungslegung ohne Fortführungsannahme und die Gründe für ihre Verwendung dargelegt werden. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den bis zum Datum unseres Berichts des „réviseur d'entreprises agréé“ erlangten Prüfungsnachweisen.

- Beurteilung der Gesamtdarstellung und Struktur des Abschlusses sowie seines Inhalts, einschließlich der Offenlegungen, und der Frage, ob die zugrunde liegenden Transaktionen und Ereignisse im Abschluss so dargestellt sind, dass ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild erreicht wird.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen, unter anderem in Bezug auf den geplanten Umfang und den Zeitplan für die Abschlussprüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich eventueller bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung entdecken.

Außerdem geben wir den mit der Unternehmensführung beauftragten Personen eine Erklärung ab, dass wir die einschlägigen ethischen Anforderungen an die Unabhängigkeit erfüllt haben, und teilen ihnen alle Beziehungen und sonstigen Sachverhalte mit, von denen vernünftigerweise angenommen werden kann, dass sie sich auf unsere Unabhängigkeit auswirken, sowie gegebenenfalls die demgegenüber getroffenen Schutzvorkehrungen.

Ernst & Young
Société Anonyme
Cabinet de révision agréé

Kerry Nichol
Luxemburg, 12. Dezember 2022

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

Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2022 hat der Anlageverwalter die Anlageverwaltungsdienstleistungen für die nachstehend aufgeführten Portefeuilles 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
- China Low Volatility Equity Portfolio

AllianceBernstein (Japan) Ltd.:

- Japan Strategic Value Portfolio

Finanzinformationen zum Fonds

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

Bitte beachten Sie, dass bei den Portefeuilles, deren Basiswährung der Yen ist, die Zahlung der Rücknahmeerlöse (der Rücknahmepreis abzüglich eines ggf. zur Anwendung kommenden Rücknahmeabschlags) von der Depotbank oder deren Vertreter normalerweise innerhalb von vier Geschäftstagen nach Annahme des Rücknahmeantrags für eine bestimmte 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
39th Floor, One Island East, Taikoo Place
18 Westlands Road, Quarry Bay
Hongkong

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

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

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

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

CACEIS Bank 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 vom Schweizer Vertreter, BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, CH-8002 Zürich, Schweiz erhältlich.

Das Dokument mit wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) des Fonds steht unter 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.

Value-at-Risk (gefährdeter Wert)

Für OGAWs kann der Value-at-Risk (VaR) auf absoluter oder relativer Basis gemessen werden. Der VaR ist ein verbreitet verwendeter Risikomaßstab für das Verlustrisiko eines bestimmten Portefeuilles an Finanzanlagen.

Für die Rentenportefeuilles hat der Anlageverwalter das Gesamtrisiko (Marktrisiko) unter Verwendung des auf absolu-

ter Basis errechneten VaR überwacht (nach dem der VaR des betreffenden Portefeuilles 20% seines NAV nicht übersteigen darf).

Während des besagten Geschäftsjahres lauteten die Tiefst-, Höchst- und Durchschnittswerte für den VaR der einzelnen Portefeuilles auf absoluter Basis gemessen folgendermaßen:

Portfeuille	Tiefstwert	Höchstwert	Durchschnitt
Dynamic Diversified Portfolio	4.31%	8.31%	5.50%
Short Duration Bond Portfolio	0.28%	1.83%	0.76%
Global High Yield Portfolio	1.54%	5.18%	3.28%
American Income Portfolio	1.38%	6.54%	3.05%
European Income Portfolio	1.26%	4.28%	2.61%
Emerging Markets Debt Portfolio	2.45%	5.71%	3.94%
Mortgage Income Portfolio	0.52%	1.80%	0.86%

Der VaR der einzelnen Portefeuilles und der VaR der Vergleichsgrößen wurden auf Grundlage eines „historischen“ Modells mit einem Vertrauensniveau von 99% und einem

Beobachtungszeitraum von einem Monat oder 20 Tagen errechnet.

Fremdfinanzierung

Für nachstehende Portefeuilles erwartet der Anlageverwalter, dass er keine Bankdarlehen benutzen wird, um die Anlagestrategie des Portefeuilles umzusetzen.

Das erwartete Fremdfinanzierungsniveau wird als Summe der Nominalbeträge der derivativen Finanzinstrumente berechnet, die vom Portfeuille gehalten werden. Laut CSSF-Rundschreiben 11/512 vom 30. Mai 2011 berücksichtigt diese Berechnungsmethode weder die Tatsache, dass ein bestimmtes deri-

vatives Finanzinstrument das Anlagerisiko des Portefeuilles erhöht oder senkt, noch erlaubt sie es, derivative Finanzinstrumente mit umgekehrten Positionen zu verrechnen. Anleger sollten sich dessen bewusst sein, dass (i) ein höheres erwartetes Fremdfinanzierungsniveau nicht automatisch ein höheres Anlagerisiko impliziert und (ii) dass das oben angegebene erwartete Fremdfinanzierungsniveau überwiegend die Verwendung von Derivaten zu Absicherungszwecken oder zum effizienten Portefeuillemanagement widerspiegelt. Darüber hinaus kann das tatsächliche Fremdfinanzierungsniveau des Portefeuilles von dem nachstehend genannten erwarteten Fremdfinanzierungsniveau abweichen:

- Dynamic Diversified Portfolio
0%-300% des NAV des Portefeuilles
- Short Duration Bond Portfolio
0%-150% des NAV des Portefeuilles
- Global High Yield Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles
- American Income Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles
- European Income Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles
- Emerging Markets Debt Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles
- Mortgage Income Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles

Infolge der Verwendung des Summe-der-Nominalbeträge-Ansatzes betrug die durchschnittliche Fremdfinanzierung der Portefeuilles im Geschäftsjahr zum 31. August 2022:

Portefeuille	Fremdfinanzierung
Dynamic Diversified Portfolio	78.25%
Short Duration Bond Portfolio	138.83%
Global High Yield Portfolio	38.17%
American Income Portfolio	176.22%
European Income Portfolio	41.07%
Emerging Markets Debt Portfolio	21.18%
Mortgage Income Portfolio	6.42%

Für die unten aufgeführten Portefeuilles hat der Anlageverwalter den Commitment-Ansatz gemäß CSSF-Rundschreiben 11/512 vom 30. Mai 2011 angewendet, um das Gesamtrisiko (Marktrisiko) zu überwachen, das sich aus der Verwendung von derivativen Finanzinstrumenten ergibt. Folglich wird das Netto-Derivatrisiko, das aus Derivattransaktionen sowie Barmitteln und anderen Anlagen entsteht, dem NAV des Portefeuilles weitgehend entsprechen.

Infolge der Verwendung des Commitment-Ansatzes betrug die durchschnittliche Fremdfinanzierung der Portefeuilles im Geschäftsjahr zum 31. August 2022:

Portefeuille	Fremdfinanzierung
Global Equity Blend Portfolio	6.11%
Global Value Portfolio	5.20%
Emerging Markets Growth Portfolio	2.02%
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	2.96%
Japan Strategic Value Portfolio	0.01%
China Low Volatility Equity Portfolio	0.00%

Vergütung

Vom 1. Januar 2021 bis zum 31. Dezember 2021 (der „Referenzzeitraum“) belief sich der Gesamtbetrag der Vergütung, die – in Barmitteln und/oder beschränkt handelbaren Wertpapieren – von AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. (die „Gesellschaft“) an ihre gesamte Belegschaft (die während des Referenzzeitraums im Durchschnitt aus 91 Mitarbeitern bestand, einschließlich ihrer Zweigniederlassung) gezahlt wurde, auf EUR 15,739,379.

Insbesondere war der oben genannte Gesamtbetrag der im Referenzzeitraum gezahlten Vergütung folgendermaßen in eine feste und eine variable Vergütung unterteilt

- Feste Vergütung: EUR 9,478,588
- Variable Vergütung: EUR 6,260,791

Es werden keine auf der Performance des Fonds basierenden Gebühren oder Gewinnbeteiligungen für die Vergütung von Mitarbeitern der Gesellschaft verwendet.

Während des Referenzzeitraums wurde von dem Fonds und/oder der Gesellschaft keine Vergütung an die identifizierten Mitarbeiter des Anlageverwalters gezahlt.

Im Referenzzeitraum belief sich der Gesamtbetrag der Vergütung, die an die identifizierte Belegschaft gezahlt wurde, die während des Referenzzeitraums aus 9 Mitarbeitern bestand, auf EUR 1,665,756 (wie folgt aufgeteilt: feste Vergütung EUR 1,159,995 und variable Vergütung EUR 505,761 was weniger als 30% der Gesamtvergütung entspricht).

Die oben genannten identifizierten Mitarbeiter setzen sich aus folgenden Kategorien von Mitarbeitern zusammen: a) Geschäftsleitung (während des Berichtszeitraums drei), b) Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft, deren Handlungen einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der Verwaltungsgesellschaft haben können oder unter die Vergütungsstufe der Geschäftsleitung fallen und die Risiken eingehen (während des Berichtszeitraums vier), und c) Kontrollfunktionen (während des Berichtszeitraums zwei).

Bitte beachten Sie, dass die vorstehend genannten Zahlen für alle von der Gesellschaft bereitgestellten Dienstleistungen gelten und keine Aufschlüsselung auf Fondsebene darstellen.

Detaillierte Informationen zu den finanziellen und nicht finanziellen Kriterien der Vergütungspolitik und -praxis, zum Entscheidungsfindungsprozess bei der Festlegung der Vergütungspolitik sowie zum Zusammenhang zwischen Bezahlung und Leistung sind im Vergütungsbericht auf der Website von AB Global verfügbar:

www.alliancebernstein.com/go/remuneration_policy

Während des Referenzzeitraums wurde eine Überprüfung der Vergütungspolitik und ihrer Umsetzung vorgenommen, wobei keine Unregelmäßigkeiten aufgedeckt wurden. Schließlich wurde während des Referenzzeitraums keine wesentliche Änderung an der Vergütungspolitik in ihrer ursprünglich vorgesehenen Form vorgenommen.

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) der SFTR folgendermaßen definiert:

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

Zum 31. August 2022 war der Fonds in Wertpapierleihgeschäften engagiert und hielt Total-Return-Swaps (TRS), die als Transaktionstyp unter die SFTR fallen.

Allgemeine Angaben

Zum 31. August 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	\$545,409	0.59%	1.94%

Global Value Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$7,888,310	1.19%	1.94%

Emerging Markets Growth Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$2,419,465	0.44%	0.19%

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$5,727,548	1.16%	1.16%

Japan Strategic Value Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	¥562,034,176	8.39%	0.74%

China Low Volatility Equity Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$2,560,912	2.10%	6.42%

Dynamic Diversified Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	
Total-Return-Swaps	\$(86,119)	(0.24)%	

Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2022 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet.

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2022 wurden keine Barsicherheiten wiederangelegt.

Angaben zur Konzentration

Zum 31. August 2022 waren Folgende die zehn größten Emittenten der bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte erhaltenen Wertpapiersicherheiten:

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	US-Regierung	\$219,320
2	Britische Regierung	\$168,461
3	Französische Regierung	\$81,577
4	Niederländische Regierung	\$64,597
5	Deutsche Regierung	\$31,658
6	Schweizer Regierung	\$9,352

Global Value Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	US-Regierung	\$3,172,045
2	Britische Regierung	\$2,436,469
3	Französische Regierung	\$1,179,864
4	Niederländische Regierung	\$934,258
5	Deutsche Regierung	\$457,873
6	Schweizer Regierung	\$135,254

Emerging Markets Growth Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	US-Regierung	\$1,608,427
2	Niederländische Regierung	\$751,295
3	Französische Regierung	\$102,884
4	Schweizer Regierung	\$86,442
5	Deutsche Regierung	\$18,187

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$9,848,340
2	Deutsche Regierung	\$5,547,599
3	US-Regierung	\$4,973,723
4	Niederländische Regierung	\$498,556
5	Schweizer Regierung	\$235,271

Japan Strategic Value Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	US-Regierung	¥389,609,931
2	Niederländische Regierung	¥161,600,881
3	Französische Regierung	¥26,500,840
4	Schwedische Regierung	¥14,439,693
5	Deutsche Regierung	¥3,944,443

China Low Volatility Equity Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	US-Regierung	\$1,690,700
2	Französische Regierung	\$1,263,191
3	Deutsche Regierung	\$763,443
4	Niederländische Regierung	\$461,959
5	Schwedische Regierung	\$52,812

Total Return Swaps

Zum 31. August 2022 wurden keine Wertpapiersicherheiten für Total-Return-Swaps erhalten.

Zum 31. August 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	Societe Generale	\$310,593
	2	Merrill Lynch	\$152,423
	3	JPMorgan Chase	\$49,436
	4	UBS AG	\$32,957

Global Value Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Societe Generale	\$4,492,132
	2	Merrill Lynch	\$2,204,515
	3	JPMorgan Chase	\$714,998
	4	UBS AG	\$476,665

Emerging Markets Growth Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	\$1,962,505
	2	JPMorgan Chase	\$456,960

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	BNP Paribas	\$3,192,683
	2	Merrill Lynch	\$1,291,140
	3	JPMorgan Chase	\$1,243,725

Japan Strategic Value Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	¥422,127,626
	2	Citigroup Global Markets Limited	¥139,906,550

China Low Volatility Equity Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	UBS AG	\$1,028,610
	2	Merrill Lynch	\$696,483
	3	Citigroup Global Markets Limited	\$511,699
	4	BNP Paribas	\$324,120

Dynamic Diversified Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	UBS AG	\$22,133
	2	JPMorgan Chase	\$(26,305)
	3	Morgan Stanley	\$(81,947)

Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapierleihe

Zum 31. August 2022 hielten vier Depotbanken die folgenden erhaltenen Sicherheiten:

Global Equity Blend Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$219,320
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$168,618
CREST	Wertpapiersicherheit	\$168,293
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$18,734

Global Value Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$3,172,045
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$2,438,737
CREST	Wertpapiersicherheit	\$2,434,035
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$270,946

Emerging Markets Growth Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$1,608,427
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$958,808

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$16,129,766
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$4,973,723

Japan Strategic Value Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	¥363,116,267
Euroclear	Wertpapiersicherheit	¥232,979,521

China Low Volatility Equity Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$2,053,621
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$1,593,801
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$584,683

Total-Return-Swaps

Zum 31. August 2022 wurden keine Wertpapier- und Barsicherheiten für Total-Return-Swaps erhalten.

Verwahrung der gewährten Sicherheiten

Total-Return-Swaps

Zum 31. August 2022 wurden keine Wertpapier- und Barsicherheiten für Total-Return-Swaps gewährt.

Erträge/Kosten

Im Geschäftsjahr zum 31. August 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	\$11,748	80%
Für dritte Partei	\$2,937	20%

Global Value Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$44,285	80%
Für dritte Partei	\$11,071	20%

Emerging Markets Growth Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$70,774	80%
Für dritte Partei	\$17,694	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	\$14,124	80%
Für dritte Partei	\$3,531	20%

Japan Strategic Value Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	¥1,029,396	80%
Für dritte Partei	¥257,349	20%

China Low Volatility Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$7,886	80%
Für dritte Partei	\$1,972	20%

Total-Return-Swaps

Dynamic Diversified Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$714,666	100%
Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$552,992	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 31. August 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	\$545,409

Global 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	\$7,888,310

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	\$2,419,465

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	\$5,727,548

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	¥562,034,176

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	\$2,560,912

Total-Return-Swaps

Dynamic Diversified Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$(59,814)
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$(26,305)
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$0

Zum 31. August 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	\$545,409

Global Value Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$7,888,310

Emerging Markets Growth Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$2,419,465

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$5,727,548

Japan Strategic Value Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	¥562,034,176

China Low Volatility Equity Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$2,560,912

Total-Return-Swaps

Dynamic Diversified Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	\$(86,119)

Die zusammenfassenden Transaktionsangaben für Sicherheitspositionen (einschließlich Barmittel), die zum 31. August 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
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 2.50%, 07/17/2024	\$58,720	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 4.13%, 07/22/2030	\$58,720	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.00%, 11/25/2030	\$58,720	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	US-amerikanische Schatzanweisung 1.63%, 05/15/2031	\$42,251	AA+	>1 Jahr	\$	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.00%, 04/22/2024	\$34,617	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2027	\$29,176	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Niederländische Schatzanweisungen 0.00%, 09/29/2022	\$29,176	AAA	Weniger als ein Monat	€	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 3.13%, 11/15/2028	\$29,175	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 1.50%, 08/15/2026	\$29,172	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 10/15/2025	\$29,171	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Societe Generale	US-amerikanische Schatzanweisung 1.38%, 10/31/2028	\$27,309	AA+	>1 Jahr	\$	Frankreich
Societe Generale	Deutsche Staatsanleihe 4.75%, 07/04/2028	\$24,000	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 08/10/2031	\$16,236	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 5.50%, 08/15/2028	\$14,805	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 02/15/2029	\$9,353	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 3.13%, 11/15/2028	\$9,353	AA+	>1 Jahr	\$	USA

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 0.63%, 12/31/2027	\$9,353	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	Schweizer Staatsanleihe 4.00%, 04/08/2028	\$9,352	AAA	>1 Jahr	CHF	USA
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.50%, 08/15/2027	\$6,245	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 11/25/2026	\$6,245	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Niederländische Staatsanleihe 0.25%, 07/15/2029	\$6,245	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 08/15/2027	\$6,243	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.88%, 09/30/2026	\$6,243	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 4.25%, 10/25/2023	\$5,580	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 3.15%, 07/25/2032	\$5,540	AA	>1 Jahr	€	USA
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.00%, 11/25/2029	\$5,303	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.00%, 01/12/2023	\$3,472	AA+	3 Monate bis 1 Jahr	\$	Schweiz
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 0.38%, 11/30/2025	\$3,420	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 11/15/2027	\$1,413	AAA	>1 Jahr	€	USA
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 01/31/2024	\$168	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.00%, 10/25/2029	\$163	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 03/22/2023	\$16	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.75%, 02/25/2028	\$10	AA	>1 Jahr	€	USA

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Global Value Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 2.50%, 07/17/2024	\$849,276	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.00%, 11/25/2030	\$849,276	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 4.13%, 07/22/2030	\$849,274	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	US-amerikanische Schatzanweisung 1.63%, 05/15/2031	\$611,068	AA+	>1 Jahr	\$	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.00%, 04/22/2024	\$500,668	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2027	\$421,972	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Niederländische Schatzanweisungen 0.00%, 09/29/2022	\$421,971	AAA	Weniger als ein Monat	€	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 3.13%, 11/15/2028	\$421,964	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 1.50%, 08/15/2026	\$421,918	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 10/15/2025	\$421,907	AA+	>1 Jahr	\$	USA

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Societe Generale	US-amerikanische Schatzanweisung 1.38%, 10/31/2028	\$394,968	AA+	>1 Jahr	\$	Frankreich
Societe Generale	Deutsche Staatsanleihe 4.75%, 07/04/2028	\$347,127	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 08/10/2031	\$234,817	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 5.50%, 08/15/2028	\$214,132	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 02/15/2029	\$135,270	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 3.13%, 11/15/2028	\$135,270	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 0.63%, 12/31/2027	\$135,269	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	Schweizer Staatsanleihe 4.00%, 04/08/2028	\$135,254	AAA	>1 Jahr	CHF	USA
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.50%, 08/15/2027	\$90,316	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 11/25/2026	\$90,315	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Niederländische Staatsanleihe 0.25%, 07/15/2029	\$90,315	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 08/15/2027	\$90,300	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.88%, 09/30/2026	\$90,292	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 4.25%, 10/25/2023	\$80,712	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 3.15%, 07/25/2032	\$80,122	AA	>1 Jahr	€	USA
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.00%, 11/25/2029	\$76,699	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.00%, 01/12/2023	\$50,218	AA+	3 Monate bis 1 Jahr	\$	Schweiz
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 0.38%, 11/30/2025	\$49,469	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 11/15/2027	\$20,430	AAA	>1 Jahr	€	USA
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 01/31/2024	\$2,434	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.00%, 10/25/2029	\$2,355	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 03/22/2023	\$238	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.75%, 02/25/2028	\$146	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.00%, 10/25/2025	\$1	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	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2027	\$375,648	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Niederländische Schatzanweisungen 0.00%, 09/29/2022	\$375,647	AAA	Weniger als ein Monat	€	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 3.13%, 11/15/2028	\$375,640	AA+	>1 Jahr	\$	USA

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 1.50%, 08/15/2026	\$375,600	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 10/15/2025	\$375,590	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 5.50%, 08/15/2028	\$190,625	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 02/15/2029	\$86,452	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 3.13%, 11/15/2028	\$86,452	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 0.63%, 12/31/2027	\$86,452	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	Schweizer Staatsanleihe 4.00%, 04/08/2028	\$86,442	AAA	>1 Jahr	CHF	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 4.25%, 10/25/2023	\$51,583	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 3.15%, 07/25/2032	\$51,207	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 0.38%, 11/30/2025	\$31,616	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 11/15/2027	\$18,187	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.75%, 02/25/2028	\$94	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
BNP Paribas	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 04/19/2023	\$3,316,179	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	US-amerikanische Schatzanweisung 0.38%, 04/30/2025	\$3,309,922	AA+	>1 Jahr	\$	Frankreich
BNP Paribas	Deutsche Staatsanleihe 1.50%, 05/15/2023	\$3,297,410	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Französische Staatsanleihe 0.10%, 03/01/2026	\$3,068,988	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2023	\$3,020,378	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 02/15/2028	\$2,238,075	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2027	\$247,140	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Niederländische Schatzanweisungen 0.00%, 09/29/2022	\$247,140	AAA	Weniger als ein Monat	€	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 3.13%, 11/15/2028	\$247,135	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 1.50%, 08/15/2026	\$247,109	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 10/15/2025	\$247,102	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 02/15/2029	\$235,300	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 3.13%, 11/15/2028	\$235,300	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 0.63%, 12/31/2027	\$235,299	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	Schweizer Staatsanleihe 4.00%, 04/08/2028	\$235,271	AAA	>1 Jahr	CHF	USA

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
BNP Paribas	Französische Staatsanleihe 0.00%, 11/25/2031	\$162,611	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 4.25%, 10/25/2023	\$140,396	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 3.15%, 07/25/2032	\$139,372	AA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 5.50%, 08/15/2028	\$125,413	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 0.38%, 11/30/2025	\$86,050	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 11/15/2027	\$11,965	AAA	>1 Jahr	€	USA
BNP Paribas	US-amerikanische Schatzanweisung 1.38%, 10/31/2028	\$5,093	AA+	>1 Jahr	\$	Frankreich
BNP Paribas	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2026	\$4,213	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.75%, 02/25/2028	\$255	AA	>1 Jahr	€	USA
BNP Paribas	Französische Staatsanleihe 1.50%, 05/25/2031	\$160	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Deutsche Staatsanleihe 0.20%, 06/14/2024	\$149	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Netherlands Government 0.75%, 07/15/2028	\$63	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.00%, 10/25/2025	\$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
Merrill Lynch	Niederländische Schatzanweisungen 0.00%, 09/29/2022	¥80,800,443	AAA	Weniger als ein Monat	€	USA
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2027	¥80,800,438	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 3.13%, 11/15/2028	¥80,798,718	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 1.50%, 08/15/2026	¥80,790,259	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 10/15/2025	¥80,788,014	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 5.50%, 08/15/2028	¥41,002,757	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 02/25/2026	¥26,495,808	AA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.35%, 01/31/2024	¥26,495,135	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 11/15/2025	¥26,494,263	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 1.25%, 06/30/2028	¥26,493,667	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.50%, 02/28/2026	¥26,464,865	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 1.50%, 11/13/2023	¥11,463,275	AAA	>1 Jahr	SEK	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 11/15/2027	¥3,911,960	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 0.75%, 05/12/2028	¥2,976,418	AAA	>1 Jahr	SEK	USA

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 10/15/2023	¥282,253	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Schatzanweisung 0.00%, 12/14/2022	¥32,483	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 1.00%, 11/25/2025	¥3,501	AA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 2.50%, 05/25/2030	¥1,252	AA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	¥279	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
BNP Paribas	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 04/19/2023	\$336,658	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	US-amerikanische Schatzanweisung 0.38%, 04/30/2025	\$336,022	AA+	>1 Jahr	\$	Frankreich
BNP Paribas	Deutsche Staatsanleihe 1.50%, 05/15/2023	\$334,752	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Französische Staatsanleihe 0.10%, 03/01/2026	\$311,562	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2023	\$306,627	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 02/15/2028	\$227,208	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.50%, 08/15/2027	\$194,895	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 11/25/2026	\$194,894	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Niederländische Staatsanleihe 0.25%, 07/15/2029	\$194,894	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 08/15/2027	\$194,862	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.88%, 09/30/2026	\$194,843	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2027	\$133,316	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Niederländische Schatzanweisungen 0.00%, 09/29/2022	\$133,315	AAA	Weniger als ein Monat	€	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 3.13%, 11/15/2028	\$133,313	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 1.50%, 08/15/2026	\$133,299	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 10/15/2025	\$133,295	AA+	>1 Jahr	\$	USA
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.00%, 01/12/2023	\$108,368	AA+	3 Monate bis 1 Jahr	\$	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 02/25/2026	\$96,907	AA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.35%, 01/31/2024	\$96,904	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 11/15/2025	\$96,901	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 1.25%, 06/30/2028	\$96,899	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.50%, 02/28/2026	\$96,793	AA+	>1 Jahr	\$	USA

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 5.50%, 08/15/2028	\$67,652	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 1.50%, 11/13/2023	\$41,926	AAA	>1 Jahr	SEK	USA
BNP Paribas	Französische Staatsanleihe 0.00%, 11/25/2031	\$16,508	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 0.75%, 05/12/2028	\$10,886	AAA	>1 Jahr	SEK	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 11/15/2027	\$6,454	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 10/15/2023	\$1,032	AA+	>1 Jahr	\$	USA
BNP Paribas	US-amerikanische Schatzanweisung 1.38%, 10/31/2028	\$517	AA+	>1 Jahr	\$	Frankreich
BNP Paribas	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2026	\$428	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Schatzanweisung 0.00%, 12/14/2022	\$119	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
BNP Paribas	Französische Staatsanleihe 1.50%, 05/25/2031	\$16	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Deutsche Staatsanleihe 0.20%, 06/14/2024	\$15	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 1.00%, 11/25/2025	\$13	AA	>1 Jahr	€	USA
BNP Paribas	Niederländische Staatsanleihe 0.75%, 07/15/2028	\$6	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 2.50%, 05/25/2030	\$5	AA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	\$1	AA	>1 Jahr	€	USA

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen

Die betroffenen Portefeuilles:

- American Income Portfolio
- Asia Ex-Japan Equity Portfolio
- China Low Volatility Equity Portfolio
- Dynamic Diversified Portfolio
- Emerging Markets Debt Portfolio
- Emerging Markets Growth Portfolio
- European Income Portfolio
- Global Equity Blend Portfolio
- Global High Yield Portfolio
- Global Value Portfolio
- Japan Strategic Value Portfolio
- Mortgage Income Portfolio
- Short Duration Bond Portfolio

Jedes der oben genannten Portefeuilles bewirbt ökologische und/oder soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“).

Im Berichtszeitraum verwendete AB den Stewardship-Ansatz von AB, um ökologische und/oder soziale Merkmale zu bewerten. Weitere Informationen zum Stewardship-Ansatz von AB finden Sie in den Abschnitten zu den verantwortungsbewussten Anlagen unter: [ABGlobalStewardship.pdf \(alliancebernstein.com\)](https://alliancebernstein.com).

Im Berichtszeitraum wurden die Bereiche Umwelt und/oder Soziales folgendermaßen beworben: (I) durch die Integration von ESG-Faktoren (d. h. ESG-Aspekte, die Risiken oder Chancen sowie Nachhaltigkeitsrisiken darstellen können) in allen Aspekten des Anlageprozesses, wobei die Auswirkungen einer Ziellanlage in Bezug auf ESG-Faktoren in allen Schritten des Anlageprozesses

beurteilt werden; und (ii) durch umfangreiches Engagement, unter anderem bei Emittenten und Regierungen, um Maßnahmen und Fortschritte bei der Erreichung von Umwelt-, Sozial- und Governance-Zielen zu fördern.

Das oben beschriebene Verfahren deckt möglicherweise nicht alle Positionen der oben genannten Portefeuilles ab. Darüber hinaus können bestimmte Arten von Vermögenswerten (wie Barmittel und bestimmte gleichwertige Wertpapiere) als neutral angesehen werden und würden daher nicht im oben beschriebenen Ansatz berücksichtigt.

Da die vorstehenden Portefeuilles die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nicht berücksichtigen, beträgt der Prozentsatz der Taxonomie-konformen Anlagen 0%.

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

* Von der Verwaltungsgesellschaft delegiert.



ALLIANCEBERNSTEIN®

ABI-SRA-SW-DA-0822